南方理财14天债券型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2014年8月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2014年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方理财14天债券	
基金主代码	202303	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年8月14日	
基金管理人	南方基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,372,569,870.45份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	南方理财14天债券A	南方理财14天债券B
下属分级基金的交易代码:	202303	202304
报告期末下属分级基金的份额总额	2,853,219,451.27份	519,350,419.18份

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下,可简称为“南方理财14天”

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,努力追求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在134天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较低风险品种, 其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	赵会军
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金级别	南方理财14天债券A	南方理财14天债券B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	62,613,367.07	8,557,120.75
本期利润	62,613,367.07	8,557,120.75
本期净值收益率	2.6057%	2.7526%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末基金资产净值	2,853,219,451.27	519,350,419.18
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方理财14天债券A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3623%	0.0051%	0.1126%	0.0000%	0.2497%	0.0051%
过去三个月	1.2005%	0.0060%	0.3418%	0.0000%	0.8587%	0.0060%
过去六个月	2.6057%	0.0051%	0.6810%	0.0000%	1.9247%	0.0051%
过去一年	5.1477%	0.0047%	1.3781%	0.0000%	3.7696%	0.0047%
自基金合同生效起至今	8.4601%	0.0055%	2.6058%	0.0000%	5.8543%	0.0055%

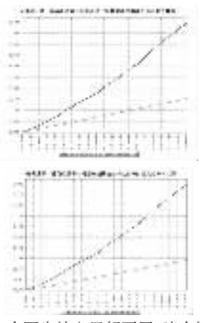
南方理财14天债券B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3862%	0.0051%	0.1126%	0.0000%	0.2736%	0.0051%
过去三个月	1.2735%	0.0060%	0.3418%	0.0000%	0.9317%	0.0060%
过去六个月	2.7526%	0.0051%	0.6810%	0.0000%	2.0716%	0.0051%
过去一年	5.4517%	0.0047%	1.3781%	0.0000%	4.0736%	0.0047%
自基金合同生效起至今	9.0516%	0.0055%	2.6058%	0.0000%	6.4458%	0.0055%

注:1、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

2、本基金计算份额净值收益率时所选取的运作周期,是以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金建仓期为本基金合同生效之日起两周,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日,经中国证监会批准,南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立,成为我国“新基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳,注册资本1.5亿元人民币。股东结构为:华泰证券股份有限公司(45%);深圳市投资控股有限公司(30%);厦门国际信托有限公司(15%);兴业证券股份有限公司(10%)。目前,公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司,在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中,南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末,南方基金管理有限公司(不含子公司)管理资产规模近2,800亿元,旗下管理51只开放式基金,1只封闭式基金,多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
夏晨曦	本基金的基金经理	2012年8月14日	-	9	香港科技大学理学硕士,具有基金从业资格。2005年5月加入南方基金,曾担任金融工程研究员、固定收益研究员、风险控制员等职务,现任固定收益部总监助理。2008年5月至2012年7月,任固定收益部投资经理,负责社保、专户及年金组合的投资管理;2012年7月至今,任南方润元基金经理;2012年8月至今,任南方理财14天基金经理;2012年10月至今,任南方理财60天基金经理;2013年1月至今,任南方理财30天基金经理。

注:1.对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》 和 《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《南方理财14天债券型证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内, 本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4次, 其中1次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致,3次是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年上半年, GDP数据和工业增加值在一季度印证了经济增长动能的疲弱,经济增速继续在底部徘徊。进入二季度,尽管房地产投资增速下滑明显,但在政府基建活动和出口活动改善的对冲下,新增固定资产投资完成额出现了显著回升。6月份 GDP增速、工业增加值等经济数据均体现了经济逐步回暖。社会融资规模和货币供应量M2也在二季度末出现了快速回升。与去年相比,央行政策层面的变化对资金面产生了积极的影响,特别是二季度公开市场操作持续净投放,通过定向降准和再贷款,向市场提供了充足流动性。上半年资金面整体呈现宽松,直接推动了银行间现券收益率的下行。10年期国债和国开债分别下行了55BP和85BP,1年期金融债和AAA短融分别下行了120BP和160BP,曲线出现陡峭化下行。上半年本基金采取了相对积极的配置策略,在曲线下行过程中维持了相对较高的久期和仓位,并对短融资产进行灵活操作,获取短期价差收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期A级基金净值收益率为2.6057%,同期业绩比较基准收益率为0.6810%。B级基金净值收益率为2.7526%,同期业绩比较基准收益率为0.6810%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,国际经济环境有望继续好转,美联储是否加息将对全球市场造成重大影响。国内经济将继续在弱势中企稳,7月份的汇丰PMI初值数据延续了强劲的回升势头。随着各地房地产政策的逐步放松,房地产销售有望出现企稳回升。收益率本年整体对债券市场收益率不利,但在政府“降低社会融资成本”的工作目标下,收益率水平短期内仍可能出现一定下行。收益率曲线将进一步陡峭化,但资金面相比上半年不会更宽松。本基金将维持适中久期,保持对短融和银行存款的重点配置,适当配置浮息债和逆回购,在保持基金良好流动性的同时稳定静态收益,并积极灵活把握市场波段操作。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括副总裁、总裁助理兼权益投资总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。其中,超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,本基金根据每日基金收益情况,以基金净收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配, 并在运作期期末集中支付。本报告期内应分配收益71,170,487.82元,实际分配收益71,170,487.82元

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 本基金托管人在对南方理财14天债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,南方理财14天债券型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方理财14天债券型证券投资基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方理财14天债券型证券投资基金2014年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:南方理财14天债券型证券投资基金

报告截止日: 2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	1,387,275,104.00	1,189,918,885.71
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,653,104,193.01	613,726,847.82
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,608,105,111.88	613,726,847.82
资产支持证券投资	44,999,081.13	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	791,113,786.67	45,500,268.25
应收证券清算款	-	-
应收利息	41,616,357.78	14,543,948.56
应收股利	-	-
应收申购款	38,173,409.37	73,261,477.29
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,911,282,850.83	1,936,951,427.63
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	532,625,411.06	212,827,021.84
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	849,428.97	432,932.13
应付托管费	251,682.66	128,276.19
应付销售服务费	790,578.33	449,122.45
应付交易费用	47,260.39	31,658.11
应交税费	-	-
应付利息	198,418.41	53,007.49
应付利润	3,751,769.58	2,515,197.58
递延所得税负债	-	-
其他负债	198,430.98	191,000.00
负债合计	538,712,980.38	216,628,215.79
所有者权益:		
实收基金	3,372,569,870.45	1,720,323,211.84
未分配利润	-	-
所有者权益合计	3,372,569,870.45	1,720,323,211.84
负债和所有者权益总计	3,911,282,850.83	1,936,951,427.63

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额3,372,569,870.45份,其中A类基金份额的份额总额为2,853,219,451.27份,B类基金份额的份额总额为519,350,419.18份。

6.2 利润表

会计主体:南方理财14天债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	85,037,564.11	44,002,019.14
1.利息收入	72,795,923.91	37,328,944.27
其中:存款利息收入	52,228,164.57	25,964,847.71
债券利息收入	12,946,966.55	9,526,895.53
资产支持证券利息收入	215,635.92	-
买入返售金融资产收入	7,405,156.87	1,837,201.03
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	12,241,640.20	6,673,074.87
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	12,241,640.20	6,673,074.87
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-
减:二、费用	13,867,076.29	8,215,487.78
1.管理人报酬	3,751,496.98	2,520,504.51
2.托管费	1,111,554.57	746,815.95
3.销售服务费	3,691,759.69	2,209,175.00
4.交易费用	-	-
5.利息支出	5,060,183.38	2,488,608.89
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	252,081.67	250,383.43
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	71,170,487.82	35,786,531.36
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	71,170,487.82	35,786,531.36

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方理财14天债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日 至 2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,720,323,211.84	-	1,720,323,211.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	71,170,487.82	71,170,487.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	1,652,246,658.61	-	1,652,246,658.61
其中:1.基金申购款	9,797,156,463.36	-	9,797,156,463.36
2.基金赎回款	-8,144,909,804.75	-	-8,144,909,804.75
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-71,170,487.82	-71,170,487.82
五、期末所有者权益(基金净值)	3,372,569,870.45	-	3,372,569,870.45
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,177,108,007.84	-	1,177,108,007.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	35,786,531.36	35,786,531.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	49,767,982.99	-	49,767,982.99
其中:1.基金申购款	6,736,479,025.48	-	6,736,479,025.48
2.基金赎回款	-6,686,711,042.49	-	-6,686,711,042.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-35,786,531.36	-35,786,531.36
五、期末所有者权益(基金净值)	1,226,875,990.83	-	1,226,875,990.83

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

杨小松 邓见梁 邓见梁

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

无

6.4.2.2 会计估计变更的说明

无

6.4.2.3 差错更正的说明

无

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 股票交易

注:无

6.4.5.1.2 权证交易

注:无

6.4.5.1.3 应支付关联方的佣金

注:无

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,751,496.98	2,520,504.51
其中:支付销售机构的客户维护费	1,340,388.97	918,455.00

注:支付基金管理人 南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.27%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.27% / 当年天数。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,111,554.57	746,815.95

注: 支付基金托管人 中国工商银行 的托管费按前一日基金资产净值0.08%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.08% / 当年天数。

6.4.5.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方理财14天债券A	南方理财14天债券B	合计
中国工商银行	190,673.11	876.54	191,549.65
南方基金	66,718.28	8,554.17	75,272.45
华泰证券	5,485.42	8.22	5,493.64
兴业证券	1,967.78	0.00	1,967.78
合计	264,844.59	9,438.93	274,283.52
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方理财14天债券A	南方理财14天债券B	合计
中国工商银行	477,341.90	7,524.74	484,866.64
南方基金	72,669.80	3,561.55	76,231.35
华泰证券	13,381.24	38.36	13,419.60
兴业证券	3,830.76	-	3,830.76
合计	567,223.70	11,124.65	578,348.35

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给 南方基金 ,再由 南方基金 计算并支付给各基金销售机构。A级基金份额和B级基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.30%和0.01%。销售服务费的计算公式为:

对应级别日销售服务费=前一日对应级别基金资产净值 X约定年费率 / 当年天数。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2014年1月1日至2014年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	72,296,675.21	40,488,668.76	-	-	-	-
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	31,095,157.81	40,573,246.03	-	-	-	-

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	6,275,104.00	39,824.30	51,032,093.98	27,966.56

注:本基金的银行活期存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.6 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额532,625,411.06元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
130235	13国开35	2014年7月1日	98.27	650,000	63,873,925.33
140204	14国开04	2014年7月1日	100.49	500,000	50,245,172.55
140316	14进出16	2014年7月1日	99.15	300,000	29,743,832.82
140410	14农发10	2014年7月1日	100.02	300,000	30,006,459.75
130236	13国开36	2014年7月1日	99.96	600,000	59,975,055.73
041470001	14国电集CP002	2014年7月1日	100.39	700,000	70,273,414.48
041354045	13川交投CP001	2014年7月1日	100.60	400,000	40,238,599.65
041469009	14京机电CP001	2014年7月1日	100.56	200,000	20,111,781.22
130243	13国开43	2014年7月2日	100.14	500,000	50,067,905.04
130236	13国开36	2014年7月2日	99.96	500,000	49,979,213.11
041456030	14深地铁CP003	2014年7月2日	99.98	400,000	39,992,551.13
041453007	14苏交通CP001	2014年7月2日	100.00	300,000	30,000,024.63
071435003	14华西证券CP003	2014年7月2日	99.98	200,000	19,996,917.30
041352041	13京能CP001	2014年7月2日	100.88	30,000	3,026,326.17
1082030	10苏国信MTN1	2014年7月4日	100.04	273,000	27,309,940.24
合计				5,853,000	584,841,119.15

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购无

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,653,104,193.01	42.27
	其中:债券	1,608,105,111.88	41.11
	资产支持证券	44,999,081.13	1.15
2	买入返售金融资产	791,113,786.67	20.23
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,387,275,104.00	35.47
4	其他各项资产	79,789,767.15	2.04
5	合计	3,911,282,850.83	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	10.21	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	532,625,411.06	15.79
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本基金合同约定:“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	125
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	129
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	80

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本基金合同约定:“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过134天”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	29.84	15.79
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.89	-
2	30天(含)—60天	6.25	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	25.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	26.55	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	25.82	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		113.61	15.79

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	283,912,351.22	8.42
	其中:政策性金融债	283,912,351.22	8.42
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,284,178,196.20	38.08
6	中期票据	40,014,564.46	1.19
7	其他	-	-
8	合计	1,608,105,111.88	47.68
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	63,873,925.33	1.89

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	041361041	13希望六和CP001	800,000	80,714,854.23	2.39
2	041470001	14国电集CP002	700,000	70,273,414.48	2.08
3	130235	13国开35	650,000	63,873,925.33	1.89
4	130236	13国开36	600,000	59,975,055.73	1.78
5	041356031	13中铝CP002	500,000	50,410,319.08	1.49
6	140204	14国开04	500,000	50,245,172.55	1.49
7	130243	13国开43	500,000	50,067,905.04	1.48
8	041354045	13川交投CP001	400,000	40,238,599.65	1.19
9	011416001	14华电股SCP001	400,000	40,118,695.77	1.19
10	1082030	10苏国信MTN1	400,000	40,014,564.46	1.19

7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	2
报告期内偏离度的最高值	0.2543%
报告期内偏离度的最低值	-0.0674%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值