

南方理财60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

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预示其未来表现,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基金合同。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方理财60天债券型证券投资基金
基金简称	南方理财60天债券
基金代码	202305
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年10月19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	958,472,714.33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60天债券A 南方理财60天债券B
下属分级基金的代码:	202305 202306
报告期末下属分级基金的份额总额	55,651,991.32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60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180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	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 基金管理人及基金托管人

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 鞠文萃 电话 0755-82763888 电子邮箱 manager@southernfund.com	姓名 赵会军 电话 010-66105799 电子邮箱 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正文的管理人互联网网址	http://www.nfnd.com.cn
基金半年度报告备置地点	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

基金级别	南方理财60天债券A	南方理财60天债券B
3.1.1. 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	16,401,978.22	987,993.34
本期利润	16,401,978.22	987,993.34
本期净值收益率	2.6592%	2.8049%
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	902,820,723.01	55,651,991.32
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:1.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

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	0.4250%	0.0068%	0.1126%	0.0000%	0.3124%	0.0068%
过去三个月	1.2310%	0.0065%	0.3418%	0.0000%	0.8892%	0.0065%
过去六个月	2.6592%	0.0072%	0.6810%	0.0000%	1.9782%	0.0072%
过去一年	5.1913%	0.0061%	1.3781%	0.0000%	3.8132%	0.0061%
自基金合同成立以来	8.0875%	0.0073%	2.3522%	0.0000%	5.7353%	0.0073%

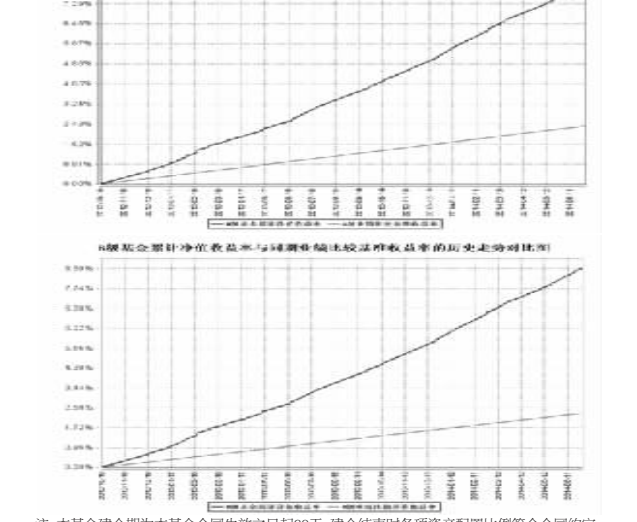
3.2.2 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.4486%	0.0068%	0.1126%	0.0000%	0.3360%	0.0068%
过去三个月	1.3034%	0.0065%	0.3418%	0.0000%	0.9616%	0.0065%
过去六个月	2.8049%	0.0072%	0.6810%	0.0000%	2.1239%	0.0072%
过去一年	5.4937%	0.0061%	1.3781%	0.0000%	4.1156%	0.0061%
自基金合同成立以来	8.6208%	0.0074%	2.3522%	0.0000%	6.2686%	0.0074%

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.本基金计算的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首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 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



注:本基金建仓期为基金合同生效之日起60天,建仓结束后各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金情况简介

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1.1亿元人民币,股权结构为: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、企业年金和专项理财投资组合。

4.2 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(或基金经理助理)期限	证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期	
夏晨熹	本基金基金经理	2012-10-19	-	9

注:1.对基金的聘任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日;“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非聘任基金经理,“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》的有关规定。

4.3 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介

4.3.1 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介
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60天债券型证券投资基金基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合规合法,没有损害基金份额持有人利益,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约定。

4.3 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介

4.3.1 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介
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60天债券型证券投资基金基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合规合法,没有损害基金份额持有人利益,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约定。

4.3 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介

4.3.1 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介
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60天债券型证券投资基金基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合规合法,没有损害基金份额持有人利益,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约定。

4.3 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介

4.3.1 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介
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60天债券型证券投资基金基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合规合法,没有损害基金份额持有人利益,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约定。

4.3 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介

4.3.1 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介
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60天债券型证券投资基金基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合规合法,没有损害基金份额持有人利益,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约定。

4.3 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介

4.3.1 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介
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60天债券型证券投资基金基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合规合法,没有损害基金份额持有人利益,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约定。

4.3 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介

4.3.1 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介
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60天债券型证券投资基金基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合规合法,没有损害基金份额持有人利益,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约定。

4.3 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介

4.3.1 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介
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60天债券型证券投资基金基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合规合法,没有损害基金份额持有人利益,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约定。

4.3 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介

4.3.1 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介
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60天债券型证券投资基金基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合规合法,没有损害基金份额持有人利益,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约定。

4.3 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介

4.3.1 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介
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60天债券型证券投资基金基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合规合法,没有损害基金份额持有人利益,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约定。

4.3 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介

4.3.1 基金管理人(或基金基金经理)及基金基金经理简介
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60天债券型证券投资基金基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合规合法,没有损害基金份额持有人利益,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约定。

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紧,本基金将维持适中久期,保持对短债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资产配置,并积极灵活运用市场波段操作。

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。会计师事务所对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,本基金管理人为确保估值工作的顺利开展,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17,389,971.56元,实际分配收益17,389,971.56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60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60天债券型证券投资基金的托管人——南方基金管理有限公司在南方理财60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、基金费用开支等方面上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各项方面的运作均严格按照基金合同的有关规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、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60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60天债券型证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

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	483,175,413.65	323,128,553.07
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	450,623,966.50	184,697,322.22
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	435,624,272.79	184,697,322.22
资产支持证券投资	14,999,693.71	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	175,932,023.90	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	10,728,331.73	4,460,903.83
应收股利	-	-
应收申购款	15,905,609.14	16,146,151.39
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,136,365,344.92	528,432,930.51
负债和所有者权益		
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	173,064,194.47	76,121,231.88
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	186,594.87	123,423.27
应付托管费	55,287.39	36,569.89
应付销售服务费	196,287.41	123,831.04
应付交易费用	23,543.35	21,165.52
应交税费	-	-
应付利息	77,244.41	26,513.79
应付股利	4,057,599.41	1,759,819.98
递延所得税负债	-	-
其他负债	231,879.28	226,800.00
负债合计	177,892,630.59	78,439,355.37
所有者权益:		
实收基金	958,472,714.33	449,993,575.14
未分配利润	-	-
所有者权益合计	958,472,714.33	449,993,575.14
负债和所有者权益总计	1,136,365,344.92	528,432,930.51

注:1. 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958,472,714.33份,其中A类基金份额的份额总额7902,820,723.01份,B类基金份额的份额总额为56,651,991.32份。

6.2 利润表

项目	本期末 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	21,241,716.19	22,647,324.31
1.利息收入	18,316,965.47	17,435,375.08
其中:存款利息收入	12,324,841.70	10,109,985.21
债券利息收入	4,370,440.64	4,754,402.70
资产支持证券利息收入	71,878.64	-
买入返售金融资产收入	1,549,804.49	2,570,987.17
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	2,914,750.72	5,211,949.23
其中:股票投资收益	-	-
债券投资收益	2,914,750.72	5,211,949.23
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)	10,000.00	-
减:二、费用	3,851,744.63	4,238,458.25
1.管理人报酬	898,120.83	1,231,122.68
2.托管费	266,109.88	364,777.23
3.销售服务费	945,892.62	1,187,649.54
4.交易费用	-	-
5.利息支出	1,515,066.02	1,194,570.41
其中:卖出回购金融资产支出	1,515,066.02	1,194,570.41
6.其他费用	226,555.28	260,338.39
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	17,389,971.56	18,408,866.06
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	17,389,971.56	18,408,866.06

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:南方理财60天债券型证券投资基金
报告期间:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	本期末 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、期初所有者权益(基金净值)	449,993,575.14	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,389,971.56
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)	508,479,139.19	-
其中:1.基金申购款	1,365,230,367.13	-
2.基金赎回款	-796,751,227.94	-
四、本期向基金份额持有人分配的利润	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	958,472,714.33	-

注:1. 基金申购和赎回款项,在收到款项时计入基金资产,在确认基金份额时计入基金负债,并计入所有者权益。

2. 基金申购和赎回款项,在收到款项时计入基金资产,在确认基金份额时计入基金负债,并计入所有者权益。

3. 基金申购和赎回款项,在收到款项时计入基金资产,在确认基金份额时计入基金负债,并计入所有者权益。

4. 基金申购和赎回款项,在收到款项时计入基金资产,在确认基金份额时计入基金负债,并计入所有者权益。

5. 基金申购和赎回款项,在收到款项时计入基金资产,在确认基金份额时计入基金负债,并计入所有者权益。

6. 基金申购和赎回款项,在收到款项时计入基金资产,在确认基金份额时计入基金负债,并计入所有者权益。

7. 基金申购和赎回款项,在收到款项时计入基金资产,在确认基金份额时计入基金负债,并计入所有者权益。

8. 基金申购和赎回款项,在收到款项时计入基金资产,在确认基金份额时计入基金负债,并计入所有者权益。

9. 基金申购和赎回款项,在收到款项时计入基金资产,在确认基金份额时计入基金负债,并计入所有者权益。

10. 基金申购和赎回款项,在收到款项时计入基金资产,在确认基金份额时计入基金负债,并计入所有者权益。

11. 基金申购和赎回款项,在收到款项时计入基金资产,在确认基金份额时计入基金负债,并计入所有者权益。

12. 基金申购和赎回款项,在收到款项时计入基金资产,在确认基金份额时计入基金负债,并计入所有者权益。

13. 基金申购和赎回款项,在收到款项时计入基金资产,在确认基金份额时计入基金负债,并计入所有者权益。