

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
送达人:中国工商银行股份有限公司

日期:2014年8月26日

\$1 重要提示

南方永利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)

2014 年度报告摘要

资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
货币类	3,319,192.58	2,356,375,300.36
银行存款	25,121,452.84	126,211,842.86
结算备付金	564,052.61	626,698.41
交易性金融资产	692,729,760.82	5,318,037,372.54
其中:股票投资	36,216,849.94	15,172,000.00
基金投资	-	-
债券投资	656,512,810.88	5,302,865,377.54
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	957,501,200.00
应收证券清算款	2,468,917.32	-
应收利息	9,384,186.44	193,954,485.47
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	333,587,562.61	8,952,756,899.64
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	-	-
应付票据	-	-
应付账款	-	-
应付职工薪酬	-	-
应付债券	-	-
应付手续费及佣金	-	-
应付交易费用	314,46.37	109,189.26
应付利息	20,841.68	398,130.46
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	-	-
负债总计	398,551,072.13	2,371,732,920.84
所有者权益:		
基金净值	315,693,160.35	6,535,978,820.58
本期利润	19,793,229.49	7,690.51
未分配利润	123,490,085.66	76,045.52
加权平均基金份额本期利润	0.0278	0.0335
本期平均基金份额净值	2.76%	5.21%
本期基金份额净值增长率	7.05%	5.27%
1.2 期末净资产和负债情况		
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
姓名	施文华	赵会军
信息披露负责人	施文华	赵会军
联系电话	0755-82763888	010-66105799
电子邮箱	managertf@sohu.com	castby@icbc.com.cn
客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	010-66105798

注:本基金在交易所买卖的证券投资基金和其他信息请见场内。

2.2 基金利润说明

本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的前提下,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。

本基金在中期和长期分别以基金的持续经营能力、宏观政策和微观政策、在非系统性因素影响下组合在一起并开始形成匹配的基础上,实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券投资收益。

业绩比较基准

本基金的业绩比较基准:一年定期存款利率+收益差额+0.1%。

风险收益特征

本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

姓名

施文华

赵会军

信息披露负责人

施文华

赵会军

联系电话

0755-82763888

010-66105799

电子邮箱

managertf@sohu.com

castby@icbc.com.cn

客户服务电话

400-889-8899

95588

传真

0755-82763889

010-66105798

4.4 债券回购方式

报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

金额单位:人民币元

基金类别

南方永利1年定期开放债券(LOF)

报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

报告期(2013年1月1日至2014年6月30日)

报告期(2013年1月1日至2