

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:2016年3月30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。本基金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。

基金管理人根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，于2016年3月25日核定了本报告期的财务指标、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，报告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。

本报告期自2015年1月01日起至12月31日止。

本报告期报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 南方理财14天债券

基金代码 200200

基金运作方式 约定开放型

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

报告期末基金资产总额 1,556,024,270.76元

基金合同的存续期 不定期

下一级基金的基金简称: 南方理财14天债券A

下一级基金的基金代码: 200203

报告期末下级基金的份额总额 1,208,607,609.56份

份额净值(单位:人民币/份): 341,416,761.21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

本基金在追求资本安全、保持资产流动性的基础上,努力也求绝对收益,为基金份额持有人谋取最大利益。

投资目标 本基金将采用积极管理的资产配置策略,将投资组合的平均期限限制在12天以内,在控制风险的前提下,尽量降低组合的净值波动率并满足流动性的需求,提高基金收益。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为“七天通知存款利率”。

风险收益特征 本基金属于投资于货币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

姓名 韩军 洪润

信息披露负责人 联系电话 0755-82763888 010-66105799

电子邮箱 manager@sunfundcn.com custodian@icbc.com.cn

客户服务电话 400-889-8899 010-66105798

传真 0755-82763889 010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 <http://www.funfund.cn>

基金年度报告备查地点 管理人的办公地址

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标 2015年 2014年 2013年

南方理财14天债券A 南方理财14天债券B 南方理财14天债券A

南方理财14天债券B 15,468,264.05 126,309,490.00 17,404,182.76

南方理财14天债券A 70,815,423.34 14,806,214.09

本期利润 73,819,177.71 15,468,264.05 126,309,490.00

本期利润 收益率 4.2896% 4.6025% 4.9682% 5.2621% 4.4674% 4.7600%

3.1.2 期间数据和指标 2015年末 2014年末 2013年末

南方理财14天债券A 341,416,761.21 2,293,560,940.23 238,641,337.70

南方理财14天债券B 1,634,707,025.62 85,616,186.22

期末基金资产净值 10,000.00 10,000.00 10,000.00

期末基金净值 10,000.00 10,000.00 10,000.00

金额单位:人民币元

注:本期已实现收益指本基金本期利息收入、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 份额净收益率(%) 份额净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0225% 0.0016% 0.3466% 0.0000% 0.0760% 0.0016%

过去六个月 1.7263% 0.0040% 0.6024% 0.0000% 1.0330% 0.0040%

过去一年 4.2896% 0.0076% 1.3781% 0.0000% 2.0114% 0.0076%

过去三年 14.3396% 0.0061% 4.1016% 0.0000% 10.1470% 0.0061%

自基金合同生效 15.7069% 0.0061% 4.7401% 0.0000% 10.0668% 0.0061%

最近三个季度 16.6464% 0.0061% 4.7401% 0.0000% 12.1054% 0.0061%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,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同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方理财14天债券B

阶段 份额净收益率(%) 份额净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0225% 0.0016% 0.3466% 0.0000% 0.0760% 0.0016%

过去六个月 1.7263% 0.0040% 0.6024% 0.0000% 1.0328% 0.0040%

过去一年 4.2896% 0.0076% 1.3781% 0.0000% 2.0114% 0.0076%

过去三年 14.3396% 0.0061% 4.1016% 0.0000% 11.1460% 0.0061%

自基金合同生效 15.7069% 0.0061% 4.7401% 0.0000% 12.1054% 0.0061%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,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。
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长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 份额净值增长率(%) 份额净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0225% 0.0016% 0.3466% 0.0000% 0.0760% 0.0016%

过去六个月 1.7263% 0.0040% 0.6024% 0.0000% 1.0330% 0.0040%

过去一年 4.2896% 0.0076% 1.3781% 0.0000% 2.0114% 0.0076%

过去三年 14.3396% 0.0061% 4.1016% 0.0000% 11.1460% 0.0061%

自基金合同生效 15.7069% 0.0061% 4.7401% 0.0000% 12.1054% 0.0061%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,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。
3.2.4 自基金合同生效以来基金每年净值增长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B

阶段 份额净值增长率(%) 份额净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0225% 0.0016% 0.3466% 0.0000% 0.0760% 0.0016%

过去六个月 1.7263% 0.0040% 0.6024% 0.0000% 1.0328% 0.0040%

过去一年 4.2896% 0.0076% 1.3781% 0.0000% 2.0114% 0.0076%

过去三年 14.3396% 0.0061% 4.1016% 0.0000% 11.1460% 0.0061%

自基金合同生效 15.7069% 0.0061% 4.7401% 0.0000% 12.1054% 0.0061%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,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。
3.2.5 合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

南方理财14天债券A

年度 已实现收益形式 直接分配金额 间接分配金额 本年变动 本年合计 备注

2015年度 64,499,090.62 10,732,071.11 -1,411,963.22 126,309,490.00

2014年度 98,490,626.51 27,166,741.04 -328,895.27 126,308,490.00

2013年度 1,210,296,758.42 18,059,000.00 1,540,600.02 70,815,423.34

合计 214,186,447.75 55,040,777.06 -192,138.57 269,943,087.13

单位:人民币元

南方理财14天债券B

年度 已实现收益形式 直接分配金额 间接分配金额 本年变动 本年合计 备注

2015年度 13,536,701.77 4,307,337.24 77,103,900.27 17,404,852.76

2014年度 5,098,162.26 1,628,472.06 -28,817.17 14,305,214.09

2013年度 9,772,985.90 5,056,162.26 -28,817.17 14,305,214.09

合计 36,329,951.89 11,201,700.91 -46,643.00 47,678,331.70

单位:人民币元

4.1 管理人报告

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,成为国内“基金新干线”的起始点。

南方基金管理总部在深圳,注册资本3亿元人民币。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,在深圳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),其南方东英境内基金公司获批成为国内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)管理资产规模超过5,000亿元,旗下管理开放式基金、多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理及基金经理助理/基金经理

姓名 职务 任期日期 离任日期

夏利娟 基金基金经理 2012年8月14日 -

夏利娟