

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

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2016年3月25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说明书及其摘要。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

## § 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
基金代码	202306
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年10月18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
报告期末基金资产净值总额	403,377,173.46元
基金份额净值	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 南方理财60天债券C
下属分级基金的基金代码	202306 202306 001043
报告期末下属分级基金的基金总额	377,916,137.06元 23,608,209.00元 812,586.11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最大的投资价值。
投资策略	本基金将采用积极的投资策略,将投资组合的平均剩余期限限制在180天以内,在控制现金流风险、流动性风险的前提下,提高基金收益。
业绩比较基准	7天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金的较低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金。
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”。	

2.3 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	陶文革
联系地址	0755-27678099

电子邮箱	manager@southfund.com
客户服务电话	400-889-8899

传真	0755-82763899
	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址	http://www.southfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§ 3 主要财务指标、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

金额单位:人民币元						
3.1.1 期间数据和指标	2015年			2014年		
	2015年			2014年		
本期已实现收益	南方理财60天债券A	南方理财60天债券B	南方理财60天债券C	南方理财60天债券A	南方理财60天债券B	南方理财60天债券C
本期已分配收益	319,061	1,749,402,620.10	6,567,043.73	37,080,141	2,471,526.16	10,372,242.00
本期净收益	319,061	1,749,402,620.10	6,567,043.73	37,080,141	2,471,526.16	10,372,242.00
本期净收益	4,610%	34.22%	5,179%	8,00%	6,488%	4,800%
本期净收益	4,610%	34.22%	5,179%	8,00%	6,488%	4,800%
3.1.2 期末数据	2015年末			2014年末		
期末基金资产净值	327,916.00	23,608.00	912,586.11	600,327	40,223	281,125
期末基金资产净值	327,916.00	23,608.00	912,586.11	600,327	40,223	281,125
期末基金资产净值	100,000.00	10,000.00	10,000.00	0	10,000.00	10,000.00
3.1.3 费率	2015年末			2014年末		
期末基金资产	327,916.00	23,608.00	912,586.11	600,327	40,223	281,125
期末基金资产	327,916.00	23,608.00	912,586.11	600,327	40,223	281,125
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、股息收益、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 基金的净值表现	3.2.1 基金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60天债券A	南方理财60天债券B					
阶段	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	业绩比较基准	业绩比较基准
过去三个月	0.8416%	0.0070%	0.346%	0.0000%	0.4060%	0.0070%
过去六个月	0.9152%	0.0070%	0.346%	0.0000%	0.5696%	0.0070%
过去一年	4.610%	0.0067%	1.781%	0.0000%	3.2324%	0.0113%
过去三年	15.389%	0.0100%	4.191%	0.0000%	11.548%	0.0100%
自基金合同生效至今	16.568%	0.0098%	4.4812%	0.0000%	12.104%	0.0098%
南方理财60天债券B	南方理财60天债券C					
阶段	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	业绩比较基准	业绩比较基准
过去三个月	0.8416%	0.0070%	0.346%	0.0000%	0.4060%	0.0070%
过去六个月	0.9152%	0.0070%	0.346%	0.0000%	0.5696%	0.0070%
过去一年	4.610%	0.0067%	1.781%	0.0000%	3.2324%	0.0113%
过去三年	15.389%	0.0100%	4.191%	0.0000%	11.548%	0.0100%
自基金合同生效至今	16.568%	0.0098%	4.4812%	0.0000%	12.104%	0.0098%
南方理财60天债券C	南方理财60天债券A 南方理财60天债券B 南方理财60天债券C					
阶段	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	业绩比较基准	业绩比较基准
过去三个月	0.8416%	0.0070%	0.346%	0.0000%	0.4060%	0.0070%
过去六个月	0.9152%	0.0070%	0.346%	0.0000%	0.5696%	0.0070%
过去一年	4.610%	0.0067%	1.781%	0.0000%	3.2324%	0.0113%
过去三年	15.389%	0.0100%	4.191%	0.0000%	11.548%	0.0100%
自基金合同生效至今	16.568%	0.0098%	4.4812%	0.0000%	12.104%	0.0098%
南方理财60天债券A	南方理财60天债券B					
阶段	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	业绩比较基准	业绩比较基准
过去三个月	0.8416%	0.0070%	0.346%	0.0000%	0.4060%	0.0070%
过去六个月	0.9152%	0.0070%	0.346%	0.0000%	0.5696%	0.0070%
过去一年	4.610%	0.0067%	1.781%	0.0000%	3.2324%	0.0113%
过去三年	15.389%	0.0100%	4.191%	0.0000%	11.548%	0.0100%
自基金合同生效至今	16.568%	0.0098%	4.4812%	0.0000%	12.104%	0.0098%
南方理财60天债券B	南方理财60天债券C					
阶段	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	业绩比较基准	业绩比较基准
过去三个月	0.8416%	0.0070%	0.346%	0.0000%	0.4060%	0.0070%
过去六个月	0.9152%	0.0070%	0.346%	0.0000%	0.5696%	0.0070%
过去一年	4.610%	0.0067%	1.781%	0.0000%	3.2324%	0.0113%
过去三年	15.389%	0.0100%	4.191%	0.0000%	11.548%	0.0100%
自基金合同生效至今	16.568%	0.0098%	4.4812%	0.0000%	12.104%	0.0098%
南方理财60天E类基金份额自2015年9月9日起开放申购和赎回业务。						
3.2.2 自基金合同生效以来基金每年净收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	3.2.2 自基金合同生效以来基金每年净收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较					
南方理财60天E类基金份额自2015年9月9日起开放申购和赎回业务。						
3.3.2 过去三年基金的利润分配情况	3.3.2 过去三年基金的利润分配情况					