（上接B067版）

61	国金证券股份有限公司	注册地址:成都市东城根上街95号 办公地址:成都市东城根上街95号 法定代表人:冉云 联系人:刘婧漪、贾鹏 联系电话:028-86690057、028-86690058 传真:028-86890126 客服电话:95310 网址:www.gjzq.com.cn
62	财富证券有限责任公司	注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼 办公地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼 法定代表人:蔡一兵 联系人:郭磊 联系电话:0731-84403319 客服电话:95317 网址:www.cfzq.com
63	恒泰证券股份有限公司	注册地址:呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座14层 办公地址:呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座14层 法定代表人:庞介民 联系人:熊丽 客服电话:4001966188 网址:www.cnht.com.cn
64	华龙证券股份有限公司	注册地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦 办公地址:兰州市城关区东岗西路638号财富大厦4楼 法定代表人:李晓安 联系人:范坤 电话:0931-4890208 传真:0931-4890628 客服电话:95368 网址:www.hlzq.com
65	华鑫证券有限责任公司	注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元 办公地址:上海市徐汇区肇嘉浜路750号 法定代表人:俞洋 联系人:杨莉莉 电话:021-54967552 传真:021-54967032 客服电话:021-32109999;029-68918888;4001099918 网址:www.cfzq.com.cn
66	国融证券股份有限公司	注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路18号 办公地址:北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西座11层 法定代表人:张智河 联系人:虞哲维 客服电话:400-660-9839 网址:www.grzq.com
67	中天证券股份有限公司	注册地址:沈阳市和平区光荣街23甲 办公地址:沈阳市和平区南五马路121号万丽城晶座4楼中天证券经纪事业部 法定代表人:马功勋 联系人:李泓麗 联系电话:024-23280806 客服电话:4006180315 网址:http://www.iztzq.com
68	五矿证券有限公司	注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元 办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元 法定代表人:赵立功 联系人:马国栋 电话:0755-83252843 传真:0755-82545500 客服电话:40018-40028 网址:www.wkzq.com.cn
69	大通证券股份有限公司	注册地址:辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座-大连期货大厦38、39层 办公地址:大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层 法定代表人:赵玺 联系人:谢立军 电话:0411-39991807 传真:0411-39673219 客服电话:4008-169-169 网址:www.daton.com.cn
70	天相投资顾问有限公司	注册地址: 北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座5层 法定代表人:林义相 联系人:谭丽 客服电话:010-66045678 传真:010-66045518 网址:http://www.txsec.com 公司基金网网址:www.jjm.com.cn
71	宏信证券有限责任公司	注册地址:四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼 办公地址:四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼 法定代表人:吴玉明 联系人:张盛 电话:010-64083702 传真:028-86199382 客服电话:4008366366 网址:www.hxzq.cn
72	网信证券有限责任公司	注册地址:沈阳市沈河区热闹路49号 办公地址: 沈阳市沈河区热闹路49号恒信大厦C座 法定代表人: 王赜 联系人:赵辉 电话:024-22955400 传真:024-22955426 客服电话:400-618-3355 网址:www.wxzq.com
73	天风证券股份有限公司	注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼 办公地址: 湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼 法定代表人: 余磊 联系人:夏昊 电话:027-87107535 传真:027-87618863 客服电话:4008000500或95391 网址:www.tfzq.com
74	诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司	注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋 法定代表人:汪静波 联系人:张裕 电话:021-80359127 传真:021-38509777 客服电话:400-821-5399 网址:www.noah-fund.com
75	深圳众禄金融控股股份有限公司	注册地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼 办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼 法定代表人:薛峰 联系人:童彩平 电话:0755-33227950 传真:0755-33227951 客服电话:4006-788-887 网址:www.zlfund.cn、www.jrnmw.com
76	上海好买基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号 办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室;上海市虹口区欧阳路196号(法兰桥创意园)26号楼2楼 法定代表人:杨文斌 联系人:张茹 电话:021-20613999 传真:021-68569916 客服电话:400-700-9665 网址:www.ehowbuy.com
77	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	注册地址:杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室 办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F 法定代表人:陈柏青 联系人:韩爱彬 客服电话:4000-766-123 网址:www.fund123.cn
78	上海长量基金销售投资顾问有限公司	注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室 办公地址: 上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层 法定代表人:张跃伟 联系人:余晓雁 电话:021-20691832 传真:021-20691861 客服电话:400-820-2899 网址:www.erichfund.com
79	上海天天基金销售有限公司	注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层 办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座大楼(东方财富大厦) 法定代表人:其实 联系人:黄妮娟 电话:021-54509998 传真:021-64385308 客服电话:95021 网址:www.1234567.com.cn
80	北京展恒基金销售股份有限公司	注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号 办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层 法定代表人:闫振杰 联系人:张云 电话:010-59601366 传真:010-62020355 客服电话:4008188000 网址:www.myfund.com
81	浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室 办公地址: 杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼4层 法定代表人:凌顺平 联系人:吴强 电话:0571-88911818-8653 传真:0571-86800423 客服电话:4008-773-772 网址:www.5ifund.com
82	中期资产管理有限公司	注册地址: 北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号 办公地址: 北京市朝阳区光华路16号中期大厦2层 法定代表人:姜新 联系人:侯英建 电话:010-65807865 传真:010-65807864 客服电话:010-65807609 网址:http://www.cifcofund.com
83	众升财富(北京)基金销售有限公司	注册地址: 北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室 办公地址: 北京市朝阳区望京东园项中心A座9层04-08 法定代表人:李招弟 联系人:李艳 电话:010-59497361 传真:010-64788016 客服电话:400-876-9988 网址:www.zscffund.com
84	和讯信息科技有限公司	注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层 办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层 法定代表人:王莉 联系人:刘洋 电话:010-85650628 传真:010-65884788 客服电话:4009200022 网址:licaike.hexun.com
85	浙江金观诚财富管理有限公司	注册地址:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室 办公地址: 杭州市拱墅区登云路43号金诚集团(锦昌大厦)13楼 法人:徐黎云 联系人:宋舒岚 电话:0571-88337888 传真:0571-88337666 客服电话:400-068-0058 网址:www.jincheng-fund.com
86	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006# 办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层 法定代表人:张彦 联系人:张燕 电话:010-83363099 传真:010-83363072 客服电话:400-166-1188 网址:https://8.jrj.com.cn
87	北京钱景基金销售有限公司	注册地址: 北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 办公地址: 北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012 法定代表人:赵荣春 联系人:高静 电话:010-59158281 传真:010-57569671 客服电话:400-893-6885 网址:www.qianjing.com
88	上海大智慧财富管理有限公司	注册地址:上海浦东杨高南路428路1号楼10-11层 办公地址:上海浦东杨高南路428路1号楼10-11层 法定代表人:申健 联系人:印强明 电话:021-20219536 传真:021-20219923 客服电话:021-20219931 网址:http://8.gw.com.cn
89	厦门市鑫鼎盛控股有限公司	注册地址: 厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504 办公地址: 厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504 法定代表人:陈洪生 联系人:梁云波 电话:0592-3122757 传真:0592-3122701 客服电话:400-918-0808 网址:www.xds.com.cn
90	上海陆金所资产管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼 法定代表人:胡学勤 联系人:宁博宇 电话:021-20665952 传真:021-22066653 客服电话:4008219031 网址:www.lufunds.com
91	珠海盈米财富管理有限公司	注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491 办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203室 法定代表人:肖雯 联系人:黄敏嫦 电话:020-89629099 传真:020-89629011 客服电话:020-89629066 网址:www.yingmi.cn
92	北京唐鼎耀华投资咨询有限公司	注册地址: 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室 办公地址: 北京朝阳区亮马桥路40号二十一世纪大厦A座303 法定代表人:张鑫 联系人:刘美薇 电话:010-53570572/13121820670 传真:010-59200800 客服电话:400-819-0868 网址:http://www.tdyhfund.com/
93	大泰金石基金销售有限公司	注册地址: 南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室 办公地址: 上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼 法定代表人:袁顾明 联系人:孟召社 电话:15621569619 传真:021-20324199 客服电话:400-928-2266/021-22267995 网址:www.ztfunds.com
94	和讯保险销售有限公司	注册地址: 北京市朝阳区东三环中路55号楼20层2302 办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街6号安邦金融中心10层 法定代表人:蒋洪 联系人:张鑫 电话:010-85256130 客服电话:4008195569 网址:www.hx-sales.com
95	北京汇成基金销售有限公司	注册地址: 北京市海淀区中关村大街11号1108 办公地址: 北京市海淀区中关村大街11号1108 法定代表人:王伟刚 联系人:丁向坤 电话:010-56282140 传真:010-62680827 客服电话:4006199059 网址:www.hcjjin.com
96	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址: 南京市玄武区苏宁大道1-5号 办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号 法定代表人:钱燕飞 联系人:王锋 电话:025-66996699-887226 传真:025-66996699 客服电话:95177 网址:www.snjjin.com
97	北京广源达信投资管理有限公司	注册地址: 北京市西城区新街口外大街28号C座六层606室 办公地址: 北京市朝阳区望京东园四区浦项中心B座19层 法定代表人:齐剑辉 联系人:姜英华 电话:4006236060 传真:010-82055860 客服电话:4006236060 网址:www.niuniufund.com
98	上海万得基金销售有限公司	注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座 办公地址: 上海市浦东新区福山路33号9楼 法定代表人:王廷富 联系人:徐亚丹 电话:021-51327185 传真:021-50710161 客服电话:400-821-0203
99	北京肯特瑞财富投资管理有限公司	注册地址: 北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06 办公地址: 北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街18号院京东总部A座17层 法定代表人:江卉 联系人:徐伯宇 电话:010-89188356 传真:010-89189566 客服电话:95118 网址:jr.jd.com
100	上海华夏财富投资管理有限公司	注册地址: 上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室 办公地址: 北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层 法定代表人:李一梅 联系人:仲秋玥 电话:010-88066632 传真:010-88066552 客服电话:400-817-5666 网址:www.amcfortune.com
101	本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告	

3.2 登记机构

名称:南方基金管理有限公司

住所及办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层

法定代表人:张海波

电话:(0755)82763849

传真:(0755)82763868

联系人:古和鹏

3.3 出具法律意见书的律师事务所

名称:广东华瀚律师事务所

注册地址:深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场A座16楼G.H室

负责人:李兆良

电话:(0755)82687860

传真:(0755)82687861

经办律师:杨忠、戴瑞冬

3.4 审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

执行事务合伙人:李丹

联系电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联系人:陈熹

经办注册会计师:薛竞、陈熹

§4 基金名称

南方理财14天债券型证券投资基金

§5 基金的类型

债券型证券投资基金(理财型)

§6 基金的投资目标

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。

§7 基金的投资范围

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括:现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

§8 基金的投资策略

8.1 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。

1、利率策略

本基金将首先采用“自上而下”的研究方法,综合研究主要经济变量指标、分析宏观经济情况,建立经济前景的情景模拟,进而判断财政政策、货币政策等宏观经济政策取向。同时,本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势,对影响资金面的因素进行详细分析与预判,建立资金面的场景模拟。

在宏观分析与流动性分析的基础上,结合历史与经验数据,确定当前资金的时间价值、通货膨胀补偿、流动性溢价等要素,得到当前宏观与流动性条件下的均衡收益率曲线。区分当前利率债收益率曲线期限利差、曲率与券间利差所面临的历史分位,然后通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比,判断收益率曲线参数变动的程度和概率,确定组合的平均剩余期限,并据此动态调整投资组合。

2、信用债投资策略

信用债券相对央票、国债等利率产品的信用利差是获取较高投资收益的来源,本基金将通过重点投资信用类债券,提高整体收益能力。本基金将在基金管理人内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下,积极投资信用债券,获取信用利差带来的高投资收益。

债券的信用利差主要受两个方面的影响,一是市场信用利差曲线的走势;二是债券本身的信用变化。本基金通过对宏观经济走势、行业信用状况、信用债券市场流动性风险、信用债券供需情况等的分析,判断市场信用利差曲线整体及分行业走势,确定各类属信用债券的投资比例。依靠内部评级系统分析各信用债券的相对信用水平、违约风险及理论信用利差,选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债券进行投资。

对于含回售条款的债券,本基金将仅买入距回售日不超过397天以内的债券,并在回售日前进行回售或者卖出。

3、放大策略

放大策略团以组合现有债券为基础,利用买断式回购、质押式回购等方式融入资金,并购买剩余年限相对较长的债券,以期获取超额收益的操作方式。在回购利率过高、流动性不足、或者市场状况不宜采用放大策略等情况下,本基金将适时降低杠杆投资比例。

8.2 投资决策依据和决策程序

1、决策依据

(1)国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提。

(2)宏观经济发展态势、国家货币政策及债券市场政策、商业银行的信贷扩张和企业信用评级。这是本基金投资决策的基础。

(3)投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策,是本基金维护投资者利益的重要保障。

2、决策程序

(1)决定主要投资原则:投资决策委员会是公司投资的最高决策机构,决定基金的主要投资原则,确立基金的投资方针及投资方向,审定基金的资产及投资组合方案。

(2)提出投资建议:投资研究团队依据对宏观经济、货币政策、债券市场基本面等的判断,结合基金合同,投资制度向基金经理提出的投资建议。

(3)制定投资决策:基金经理在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下,根据研究员提供的投资建议以及自己的分析判断,做出具体的投资决策。

(4)进行风险评估:风险管理部门对公司旗下基金投资组合的风险进行监测和评估,并出具风险监控报告。

(5)评估和调整决策程序:基金管理人有权根据环境的变化和实际的需要调整决策的程序。

§9 基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:七天通知存款税后利率。

通知存款是一种不约定存期,支取时需提前通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款,具有存期灵活、存取方便的特征,同时可获得高于活期存款利息的收益。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

§10 基金的风险收益特征

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。

§11 基金投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至2017年6月30日(未经审计)。

1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,135,860,064.22	52.68
	其中:债券	1,135,860,064.22	52.68
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	199,766,699.85	9.27
	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	800,046,967.63	37.11
4	其他资产	20,330,919.82	0.94
5	合计	2,156,004,651.32	100.00

1.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	17.06	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	282,927,364.44	15.13
	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。

1.3 基金投资组合平均剩余期限

1.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期未投资组合平均剩余期限	123
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	131
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	51

报告期内投资组合平均剩余期限超过120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。

1.3.2 报告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	10.95	15.13
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.27	-
2	30天(含)—60天	21.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	26.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	3.73	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	51.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		114.18	15.13

1.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注::本报告期内,本基金未发生平均剩余存续期超过240 天的情况。

1.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	104,596,064.07	5.59
	其中:政策性金融债	104,596,064.07	5.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	129,963,002.46	6.95
6	中期票据	-	-
7	同业存单	901,301,007.69	48.19
8	其他	-	-
9	合计	1,135,860,064.22	60.73
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	4,975,515.10	0.27

1.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111713061	17浙商银行CD061	1,000,000	97,800,121.84	5.23
2	111799063	17恒商银行CD068	1,000,000	95,288,562.73	5.09
3	170401	17农发01	600,000	59,838,203.56	3.20
4	011761006	17冀中能源SCP001	500,000	49,986,696.99	2.67
5	111797367	17重庆银行CD092	500,000	49,728,704.50	2.66
6	111797611	17广州农村商业银行CD062	500,000	49,720,339.90	2.66
7	111798070	17重庆农村商行CD112	500,000	49,687,259.81	2.66
8	111793064	17天津银行CD026	500,000	49,479,889.84	2.65
9	111780124	17宁波银行CD114	500,000	49,477,118.38	2.65
10	111719185	17恒丰银行CD185	500,000	49,476,047.24	2.65

1.7

1.7.1 “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	
报告期内偏离度的最高值	0.0928%
报告期内偏离度的最低值	-0.0278%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0244%

1.7.2 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:无

1.7.3 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:无

1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.9 投资组合报告附注

1.9.1本基金采用“摊余成本法”计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益。

1.9.2本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,480,789.94
4	应收申购款	13,850,129.88
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	20,330,919.82

§12 基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

南方理财14天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
2012.08.14-2012.12.31	1.1950%	0.0060%	0.5264%	0.0000%	0.6686%	0.0060%
2013.01.01-2013.12.31	4.4674%	0.0062%	1.3781%	0.0000%	3.0793%	0.0062%
2014.01.01-2014.12.31	4.9582%	0.0060%	1.3781%	0.0000%	3.5801%	0.0060%
2015.01.01-2015.12.31	4.2896%	0.0076%	1.3781%	0.0000%	2.9115%	0.0076%
2016.01.01-2016.12.31	3.0466%	0.0068%	1.3819%	0.0000%	1.6647%	0.0068%
2017.01.01-2017.06.30	1.8724%	0.0030%	0.6810%	0.0000%	1.1914%	0.0030%
自基金合同生效起至今	21.4628%	0.0032%	6.9107%	0.0000%	14.5521%	0.0032%

南方理财14天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
2012.08.14-2012.12.31	1.3070%	0.0060%	0.5264%	0.0000%	0.7806%	0.0060%
2013.01.01-2013.12.31	4.7669%	0.0062%	1.3781%	0.0000%	3.3828%	0.0062%
2014.01.01-2014.12.31	5.2621%	0.0060%	1.3781%	0.0000%	3.8840%	0.0060%
2015.01.01-2015.12.31	4.5625%	0.0076%	1.3781%	0.0000%	3.2144%	0.0076%
2016.01.01-2016.12.31	3.4728%	0.0068%	1.3819%	0.0000%	2.0908%	0.0068%
2017.01.01-2017.06.30	2.0187%	0.0030%	0.6810%	0.0000%	1.3377%	0.0030%
自基金合同生效起至今	23.3439%	0.0035%	6.9107%	0.0000%	16.4332%	0.0035%

§13 基金的费用概览

13.1 与基金运作有关的费用

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、基金的销售服务费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.27%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.27 %÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.08%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、基金销售服务费

本基金A 类基金份额的销售服务费年费率为0.30%。

本基金B 类基金份额的销售服务费年费率为0.01%。

各类基金份额的基金销售服务费计提的计算公式如下:

H=E×基金销售服务费年费率÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中划出,经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第4-9项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

13.2 与基金销售有关的费用

1、本基金不收取申购费。

2、本基金不收取赎回费。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

§14 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据基金法及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在“重要提示”部分,对“重要提示”进行了更新。

2、在“绪言”部分,对“绪言”进行了更新。

3、在“释义”部分,对“释义”进行了更新。

4、在“基金管理人”部分,对“主要人员情况”进行了更新。

5、在“基金托管人”部分,对“基金托管人”进行了更新。

6、在“相关服务机构”部分,对“销售机构”进行了更新。

7、在“基金份额的分类”部分,对“基金份额的分类”进行了更新。

8、在“基金的申购和赎回”部分,对“申购与赎回的数额限制”进行了更新。

9、在“基金的投资”部分,对“基金投资组合报告”进行了更新,对“基金业绩”进行了更新。

10、在“基金份额持有人服务”部分,对“基金份额持有人服务”进行了更新。

11、在“其他应披露事项”部分,对“其他应披露事项”进行了更新。

12、对部分其他表述进行了更新。

南方基金管理有限公司

2017年9月19日

南方基金关于旗下部分基金增加鄞州银行为代销机构及开通相关业务的公告

根据南方基金管理有限公司(简称“本公司”)与宁波鄞州农村商业银行股份有限公司(简称“鄞州银行”)签署的销售合作协议,鄞州银行将自2017年9月19日起代理销售本公司旗下部分基金。现将有关事项公告如下:

一、适用基金及业务范围

从2017年9月19日起,投资人可通过鄞州银行办理上述列表中对应基金的开户、申购、赎回、定投、转换等业务。

编号	基金代码	基金名称	定投业务	转换业务
1	000086	南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金A类	不开通	不开通
2	000482	南方医药保健灵活配置混合型证券投资基金	开通	开通
3	000527	南方新优享灵活配置混合型证券投资基金	开通	开通
4	000654	中国梦灵活配置混合型证券投资基金	开通	开通
5	000844	南方绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金	不开通	不开通
6	000955	南方产业活力股票型证券投资基金	开通	开通
7	001421	南方量化成长股票型证券投资基金	开通	开通
8	002160	南方转型驱动灵活配置混合型证券投资基金	开通	开通
9	002851	南方品质优选灵活配置混合型证券投资基金	开通	开通
10	003161	南方安泰养老混合型证券投资基金	开通	开通
11	003473	南方天天利货币市场基金A类	开通	开通
12	003474	南方天天利货币市场基金B类	开通	开通
13	003610	南方荣安定期开放混合型证券投资基金A类	不开通	不开通
14	003611	南方荣安定期开放混合型证券投资基金C类	不开通	不开通
15	202006	南方成份精选混合型证券投资基金(前端)	开通	开通
16	202011	南方优选价值混合型证券投资基金(前端)	开通	开通
17	202101	南方宝元债券型基金	开通	开通
18	202