

南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金

[2014] 第一季度报告

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

报告期起始日期:2014年4月22日

\$1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定于2014年4月18日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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财务资料未经审计。

报告期自2014年1月1日起至2014年3月31日止。

\$2 基金产品概况

基金名称	南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金
交易代码	000022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月3日
报告期末基金份额总额	259,623,552.31份
投资目标	本基金追求在扣除各项费用之后与标的指数相当的总回报。
投资策略	本基金为被动式指数基金，主要采用抽样复制法，即标的指数中的基础权重股占基金资产的比例不低于80%，并根据标的指数成份股及其权重的变化定期调整股票组合，并根据基金合同约定的现金留存比例配置现金，进行现金管理，以及进行现金类资产投资等，以保证基金净值增长率尽可能地跟踪标的指数的收益率。
业绩比较基准	中债-中短期企业债指数95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金，属于基金中风险收益水平适中的品种。本基金主要采用抽样复制法构造指数的指数基金，具有与标的指数相同的收益、风险特征，即标的指数所代表的债券市场相匹配的风险收益特征。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金A类
下属分级基金的交易代码	000022
报告期末下属分级基金份额总额	232,632,598.93份
报告期末基金资产净值	27,694,933.38份

\$3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金A类	
1.本期已实现收益	1,375,709.96元
2.本期利润	10,343,433.11元
3.加权平均基金份额本期利润	0.0295
4.期末基金资产净值	239,938,214.72元
5.期末基金份额总额	27,824,105.14份
6.期末可供分配基金份额利润	0.0004
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。 2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。	

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

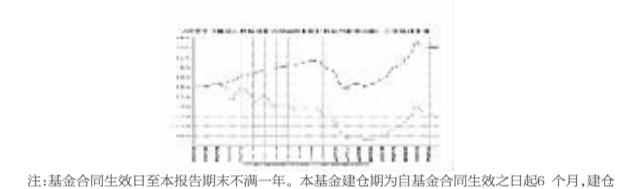
南方中债中期票据指数债券型发起式A

阶段	净值增长率(①)	净值增长率标准差(②)	业绩比较基准收益率(③)	业绩比较基准收益率标准差(④)
过去三个月	2.69%	0.07%	1.64%	0.07%

南方中债中期票据指数债券型发起式C

阶段	净值增长率(①)	净值增长率标准差(②)	业绩比较基准收益率(③)	业绩比较基准收益率标准差(④)
过去三个月	2.58%	0.07%	1.64%	0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:基金合同生效日至报告期末不满一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月内，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介		
姓名 职务	任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期	说明
刘朝阳 基金经理	2013年5月31日 -	6
北大光华工商管理学院金融硕士，2007年7月加入南方基金管理有限公司，历任南方基金管理研究部研究员、债券交易员及固定收益部基金经理，2011年10月至今，任南方基金管理有限公司基金经理。2013年5月至今，任南方基金管理有限公司基金经理。		
4.2 管理人对报告期内基金运作合规性的说明		
4.3 管理人对宏观经济运行情况的说明		
4.4 管理人对证券市场总体走势的说明		
4.5 管理人对本基金运作合法合规的说明		
4.6 管理人对基金投资策略和运作表现的说明		
4.7 管理人对基金投资策略和运作表现的说明		
4.8 公平交易制度执行情况		
4.9 基金管理人公平交易制度的执行情况		
5.1 基金管理人对报告期内基金投资策略和运作表现的说明		
5.2 基金管理人对报告期内基金投资策略和运作表现的说明		
5.3 基金管理人对报告期内基金投资策略和运作表现的说明		
5.4 基金管理人对报告期内基金投资策略和运作表现的说明		
5.5 基金管理人对报告期内基金投资策略和运作表现的说明		
5.6 基金管理人对报告期内基金投资策略和运作表现的说明		
5.7 基金管理人对报告期内基金投资策略和运作表现的说明		
5.8 基金管理人对报告期内基金投资策略和运作表现的说明		
5.9 基金管理人对报告期内基金投资策略和运作表现的说明		
5.10 投资组合报告附注		
5.11 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。		
5.12 基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现涉及诉讼、仲裁等法律纠纷的情形。		
5.13 基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现因涉嫌犯罪被司法机关立案侦查或立案调查，尚未结案的情形。		
5.14 基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现因涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或立案调查，尚未结案的情形。		
5.15 基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现因涉嫌违法违规被中国证监会立案稽查，尚未结案的情形。		
5.16 基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现因涉嫌违法违规被中国证监会立案稽查，尚未结案的情形。		
5.17 基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现因涉嫌违法违规被中国证监会立案稽查，尚未结案的情形。		
5.18 基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现因涉嫌违法违规被中国证监会立案稽查，尚未结案的情形。		
5.19 基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现因涉嫌违法违规被中国证监会立案稽查，尚未结案的情形。		
5.20 基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现因涉嫌违法违规被中国证监会立案稽查，尚未结案的情形。		
5.21 基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现因涉嫌违法违规被中国证监会立案稽查，尚未结案的情形。		
5.22 境外资产托管人		
姓名	境外资产托管人	
名称	The Bank of New York Mellon	
地址	One Wall Street New York, NY 10286	
办公地址	One Wall Street New York, NY 10286	
邮政编码	10286	

§5 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

5.1 报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金管理办法》、《证券投资基金运作指引》的规定，未利用固有资金买卖本基金份额。

5.2 报告期内，基金管理人未持有本基金。

5.3 报告期内，基金管理人未持有股票。

5.4 报告期内，基金管理人未持有基金。

5.5 报告期内，基金管理人未持有债券。

5.6 报告期内，基金管理人未持有贵金属。

5.7 报告期内，基金管理人未持有商品期货。

5.8 报告期内，基金管理人未持有金融衍生品。

5.9 报告期内，基金管理人未持有期权、期货投资。

5.10 报告期内，基金管理人未持有权证。

5.11 报告期内，基金管理人未持有资产支持证券。

5.12 报告期内，基金管理人未持有其他金融工具。

5.13 报告期内，基金管理人未持有其他投资。

5.14 报告期内，基金管理人未持有其他资产。

5.15 报告期内，基金管理人未持有其他负债。

5.16 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.17 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.18 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.19 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.20 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.21 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.22 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.23 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.24 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.25 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.26 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.27 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.28 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.29 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.30 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.31 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.32 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.33 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.34 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.35 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.36 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.37 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.38 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.39 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.40 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.41 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.42 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.43 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.44 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.45 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.46 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.47 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.48 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.49 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.50 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.51 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.52 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.53 报告期内，基金管理人未持有其他资产或负债。

5.54 报告期内，基金管理