

南方理财30天债券型证券投资基金

[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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期: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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

南方理财30天债券

交易代码 20307

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2013年1月22日

报告期末基金份额总额 430,387,825.00份

基金管理人承诺本基金在安全、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长。

本基金采取合理的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在90天以内，在控制风险的前提下，追求基金净值的稳定增长。

本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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年3月31日止。

南方理财30天债券

基金资产净值 306,916,794.42份

报告期末基金份额总额 61,021,357.99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) 南方理财30天债券A 南方理财30天债券B

1. 本期已实现收益 2,020,819.37 656,171.18

2.本期利润 2,020,819.37 656,171.18

3.期末未分配收益 306,916,794.42 61,021,357.99

注:本基金已实现收益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

南方理财30天债券A

阶段 净值收益率① 0.009% 0.0381% ② 0.0000% 0.016% ③ 0.005% ④

过去三个月 1.2550% 0.009% 0.0381% ② 0.0000% 0.016% 0.005%

南方理财30天债券B

阶段 净值收益率① 0.009% 0.0381% ② 0.0000% 0.016% ③ 0.005% ④

过去三个月 1.326% 0.009% 0.0381% ② 0.0000% 0.016% 0.005%

注:1.本基金每日计算日收益并分配，并在运作周期末集中支付。

2.本基金计算日净值增长率时所选的运作周期，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率与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:南方理财30天债券A与业绩比较基准的净值增长率比较图

图:南方理财30天债券B与业绩比较基准的净值增长率比较图

注:本基金建仓期为本基金合同生效之日起20天内，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 证券从业年限 说明

夏晓峰 本基金基金经理 2013年1月22日 - 8

夏晓峰，清华大学学士，具备基金经理资格。2005年5月加入南方基金管理有限公司，历任研究员、风控经理等职务，现任本基金基金经理助理。2008年5月至2012年7月，任本基金投资部总监助理。2012年7月至2013年1月，任本基金投资部总监助理。2013年1月至今，任南方理财60天基金经理，2012年10月至今，任南方理财30天基金经理，2013年1月至今，任南方理财30天债券基金经理。

注:1.对本基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解约日期，对之后的基金经理任职日期，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人报告期内本基金运作合规性说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施细则，严格履行了《南方理财30天债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格执行公平执行，公平对待旗下管理的所有基金及投资组合。

4.3.2 跟踪交易行为的专项说明

本基金在报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日均未出现向交易所申报买卖量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次，是由于指定期接资金接投资人账户后被冻结所致。

4.4 报告期内基金的销售策略和销售情况说明

一季度资金面整体偏宽松，春节后公开市场操作较好地平滑了资金面的季节性波动，春节后在现券回购银行、同业存款利率和公开市场利率等要素的共同作用下资金面逐步宽松态势，资金利率年初显著下行，短融收益率、同业存单收益率水平随之同步下行。组合在年初保持了较高的仓位和仓位调整水平，在收益率快速下行阶段保持了相对较好的静态收益水平并获取了一定资本利得收益。需要说明的是，由于组合持仓在3月份出现了短期内的大幅增长，而当时的再投资收益非常低，因此显著摊薄了组合整体仓位及收益水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在报告期内的10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处罚，处罚的简要情况。

4.5 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 -

2 反向回购资金 -

3 反向收益 - 5,743,372.06

4 反向回购款 203,000.00

5 其他应收款 -

6 持待用 -

7 其他 -

8 合计 5,946,372.06

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目 南方理财30天债券A 南方理财30天债券B

报告期初基金份额总额 95,213,214.83 54,127,677.25

报告期基金份额变动数 440,151,374.44 68,733,499.04

减报告期基金份额总额 165,548,659.84 61,839,819.29

报告期末基金份额总额 309,616,794.42 61,021,357.99

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“南方聚利”。

§ 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)

1.本期已实现收益 5,249,994.22

2.本期利润 6,398,358.18

3.期末平均基金份额利润 0.0217

4.期末基金资产净值 301,152,646.63

5.期末基金资产净值 1,023

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.所述基金本期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要低于所示数字。

3.2 基金报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 0.22% 0.12% 0.04% 0.01% 0.16% 0.11%

过去三个月 2.20% 0.12% 0.04% 0.01% 0.16% 0.11%

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“南方聚利”。

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

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)

1.本期已实现收益 5,249,994.22

2.本期利润 6,398,358.18

3.期末平均基金份额利润 0.0217

4.期末基金资产净值 301,152,646.63

5.期末基金资产净值 1,023

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金在报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金代销机构在报告期内不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金代销机构在报告期内不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。