

更新)摘要

(一) 上海世茂公司
名称: 上海世茂房地产有限公司
住所: 上海市静安区临汾路101号福平一路六号免稅商务大厦第11、32、33层楼
法定代表人: 朱建荣
注册资本: 人民币1000000000元
电话: (021) 122763340
传真: (021) 122763340

(二) 上海世茂公司
名称: 上海世茂集团
住所: 上海市浦东新区外环线内1000号宝发广场A座1601室
法定代表人: 李国良
电话: (8621) 632477860
传真: (8621) 632477861
经办人员: 魏志盛、魏志盛

(三) 律师事务所
名称: 上海中远(集团)会计师事务所(特别普通合伙)
住所: 上海市静安区南京西路1008号中远大厦第14层01单元
负责人: 王利军
住所: 上海市静安区南京西路1008号中远大厦第14层01单元
经办人员: 王利军、王利军

联系人: 唐敏
联系电话: 021-12228888

经办公会议、前席、投票
九、基金名称
南方资产—大成债券证券投资基金
五、基金的范围
债券证券投资基金
六、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,力求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
七、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)的定期存款和大额存单、利率互换、国债期货、在30天以内(含30天)的债券、资产支持证券、中期票据、期限在(含一年)以内、信用评级在A-以上的中央银行票据、短期融资券以及法律法规和中国证监会允许本基金投资的其它固定收益类金融工具。
如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其他品种纳入投资范围。

本基金将采用积极投资策略,将投资组合的平均年化预期回报控制在134天以内,在控制利率风险,尽量降低波动性的前提下实现资产增值的目的,具体策略如下:

1. 利率策略

本基金将首先使用“自上而下”的研究方法,建立利率与宏观经济基本面、财政收支政策状况、货币信贷政策、国际收支状况、通货膨胀率、国际利率水平、中央银行行为等因素的模型,分析利率变动趋势,对利率期限结构进行预测并据此进行利率资产组合,建立利率资产组合的久期,根据利率变动趋势适时调整久期,以获取利率波动带来的收益。

在分析并判断未来利率变动趋势的基础上,结合利率期限结构,确定当前资金的时间价值、流动性溢价、信用溢价、利率预期等因素,并据此确定利率资产组合的久期,并据此确定利率资产组合的期限和权重,最终形成利率资产组合,并据此进行利率资产组合投资。

2. 信用投资策略

信用债券主要指企业债、国债等带有信用风险的资产,本基金采取自下而上的策略,通过信用评估与债券筛选,剔除违约风险大、信用等级下降的资产,在信用评估的基础上,通过信用利差风险控制手段下,积极投资信用债券,信用债券主要投向以下方面:

一是信用评级较高的信用债,二是信用等级下降的信用债。本基金

[illegible][illegible]

其中：债券	1,608,105,111.88	41.11
资产支持证券	44,999,081.13	1.15
2 买入返售金融资产	791,113,786.67	20.23
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	1,367,275,104.00	35.47
4 其他各项资产	79,789,767.15	2.04
5 合计	3,911,262,850.83	100.00

12. 债券投资购置情况

		金额单位：人民币元
序号	项目	占基金资产净值的比例(%)

1	报告期内新增回购融资资金		10.21
	其中：买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	532,625,411.00	15.79
	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分别为报告期内每个交易日债券回购融资资产净值比例的前5名平均值。

报告期内本基金的资金余额占基金资产净值的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，本基金未发生该情形。

1.2.5 基金组合投资比例符合说明
1.2.5.1 投资组合比例限制基金资产情况

报告期内投资组合平均剩余期限	125
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	129
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	80

注：报告期内投资组合平均剩余期限100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，本基金发生违约情况。

13.2 报告期内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	各期限负债占基金资产
1	30天以内	29.84	15.79

其中：剩余存续期超过397天的浮动利

	单债		
2	30天(含)-60天	6.25	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	25.16	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	26.55	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	25.82	-

	其中：剩余存款期限超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	113.61	(15.79)
1.4 期末按债券品种分类的债券投资组合			
			金额单位：人民币元
序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	283,912,351.22	8.42
	其中：政策性金融债	283,912,351.22	8.42

4	企业债券		--		
5	企业短期融资券	1,284,178,196.20	38.08		
6	中期票据	4,014,564.46	1.19		
7	其他				
8	合计	16,085,115,118.88	47.68		
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	63,873,925.33	1.89		
1.5 期末投资成本占基金资产净值比重大小排序的前十名债券投资明细					
			金额单位：人民币元		
序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	143436140	14国债六期(T0614)	800,000	80,714,854.73	7.36

2	04170001	1408 恒丰 CP002	700,000	70,273,414.48	2.08
3	130235	13 国开债	650,000	63,873,935.33	1.89
4	130236	13 国开债 CP36	600,000	59,975,053.73	1.78
5	01335601	13 中财债 CP002	500,000	50,410,319.08	1.49
6	140204	14 国开 04	500,000	50,245,172.55	1.49
7	120243	12 国开 43	500,000	50,607,965.08	1.48
8	01354045	1310 交通债 SCP001	400,000	40,238,599.65	1.19
9	011416001	14 华电债 SCP001	400,000	40,118,695.77	1.19
10	080230	10 国债 0230	400,000	40,014,544.46	1.19

项目	偏差情况
报告期内偏差的绝对值在0.25(含)-0.50之间的次数	2
报告期内偏差的最高值	0.2543%
报告期内偏差的最低值	-0.0674%
报告期内每个交易日偏差的绝对值的简单平均值	0.1038%

1.7 期末公允价值占基金资产净值比例大于等于所有资产支持证券投资的面

				金额单位：人民币元	
序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	14809035	14开元AA1	450,000	44,999,081.13	1.33

1.8 报告期内每笔买入

1.2.1 本基金采用“摊余成本法”计价,即以公允价值买入成本列示,按照票面利率或约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,每日计提损益。

1.2.2 本基金对货币基金持有剩余期限小于30天但剩余存续期超过30天的浮动利率债券,也不存在该类浮动利率债券的摊余成本与当前公允价值存在50%的情况。

1.2.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出現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、处罚的情况。

1.2.4 本基金其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-

3	应收利息	41,616,357.78
4	应收申购款	38,173,409.37
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	79,789,767.15
十一、基金的负债		
基金管理人因信息披露、诚信义务、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 近期收益,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天债券A		

阶段	净收益率 率①	净收益率 标准差②	业绩比 基准收益 率③	业绩比基 准收益 率差④	①-③	②-④
2012.14-2012.12.31	1.1959%	0.0059%	0.5264%	0.0000%	0.6695%	0.0059%
2013.1.1-2013.12.31	4.4547%	0.0524%	1.3781%	0.0000%	3.0767%	0.0524%
2013.1.1-2014.6.30	2.6057%	0.0511%	0.6810%	0.0000%	1.9247%	0.0511%
自基金成立至今	8.4661%	0.0555%	2.6058%	0.0000%	5.8543%	0.0555%

南方理财16大蓝筹B						
阶段	净收益率 率①	净收益率 标准差②	业绩比基 准收益 率③	业绩比基 准收益 率差④	①-③	②-④
2013.1.14-2013.12.31	1.3078%	0.0058%	0.5363%	0.0000%	0.7706%	0.0058%

2013.1.1-2013.12.31	4.7609%	0.0052%	1.3781%	0.0000%	3.3828%	0.0052%
2014.1.1-2014.6.30	7.2700%	0.0051%	0.6810%	0.0000%	2.0716%	0.0051%
自基金成立起至今	9.0516%	0.0055%	2.6058%	0.0000%	6.4458%	0.0055%

十三、基金费用概况

(一)与基金运作有关的费用

1.基金费用的构成

(1)基金管理人管理费；

(2)基金托管费；

(3)基金的销售服务费；

(4)《基金合同》生效日与基金相关的信息披露费；

(5)《基金合同》生效日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；

(9) 根据《基金合同》和《基金合同》约定, 可以在基金财产中列支的其他费用。

2. 托管费计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金托管人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 2.2% 年费率计提。管理费按以下方法计算:

$$H = R \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

R 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提, 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。遇法定节假日、公休假期, 支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费按以下方法计算:

$$H = R \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

R 为前一日的基金资产净值

基金托管人每月于次月五个工作日内,按约定方式,将基金管理人应支付给基金托管人的托管费划入基金托管人指定账户。次月五个工作日内,支付托管费。

(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0.25%。

各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

$H = E \times R \div 365$

其中:
H为每日计提的基金销售服务费
E为前一日的基金资产净值
R为基金销售服务费年费率

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基金销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月五个工作日内从基金资产中划出,经基金托管人复核后支付给各基金份额持有人。若遇法定节假日、休息日等,基金销售服务费顺延至下一个工作日支付。

(4) 基金赎回费

基金赎回费计入基金的第二项费用”,根据有关法规及相应协议约定,按照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。

[illegible]

1. 在“基金管理人”部分,对基金管理人主要人员情况进行了更新;

2. 在“基金托管人”部分,对基金托管人相关信息进行了更新;

3. 在“相关服务机构”部分,对代销机构名单和会计师事务所信息进行了更新;

4. 在“基金投资”部分,补充了本基金最近一期投资组合报告和股票业绩;

5. 对“基金份额持有人服务”进行了更新;

6. 对“基金应披露事项”进行了更新;

7. 对部分表述进行了更新。

南方基金管理有限公司
2014年9月26日