

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
基金合同生效日期：2015年3月26日

§ 1 重要提示

基金管理人和基金托管人承诺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责任。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字并由董事长签章。

基金托管人对基金管理人的监督意见：勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金投资人在购买基金时，应认真阅读基金的招募说明书、基金合同、基金产品说明、基金定期报告、基金年度报告等，并不代表其未来表现。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。

本报告期自2014年1月01日起至2014年12月31日止。

本年度报告摘要自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，阅读年度报告全文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况	南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金
基金简称	南方中债中期票据指数债券型发起式
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	136,062,404.65份
基金合同存续期	不定期
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A
下属分级基金的交易代码：	000022 000023
报告期末下属分级基金的份额总额	123,285,077.79份 12,776,962.86份

2.2 基金产品说明	南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金
投资目标	本基金追求取得在扣除各项费用后与之前标的指数相似的总回报。
投资策略	本基金为货币市场基金，主要采用抽样复制法，以跟踪的标的成份为基准，综合考虑收益类型、流动性等因素构建组合，并根据本基金日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间债券交易特性及交易成本等情况，进行优化操作，以力争对标的指数的有效跟踪。
业绩比较基准	中债-国债收益率指数*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为货币型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金主要采用抽样复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似，以及标的指数所代表的证券交易市场相似的风险特征。

2.3 基金管理人员和基金托管人	基金管理人 基金托管人
名称	南方基金管理有限公司 中国银行股份有限公司
信息披露负责人姓名	鲍文革 王永民
信息披露负责人联系电话	0755-82763888 95566
电子邮箱	manager@southernfund.com fcld@bankofchina.com
客户服务电话	400-889-8899 95566
传真	0755-82763889 010-66594942

2.4 信息披露方式	登载基金年度报告正本的管理人互联网网址	http://www.southernfund.com
	基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年5月3日(基金合同生效日)至2013年12月31日
南方中债中期票据指数债券型发起式A	南方中债中期票据指数债券型发起式C	南方中债中期票据指数债券型发起式C
本期已实现收益	8,767,254.53	1,737,509.16
本期利润	21,582,660.27	2,530,436.27
加权平均基金份额本期利润	0.0102	0.0070
本期基金份额净值增长率	8.49%	8.12%
3.1.2 期间数据和指标	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.0668	0.0616
期末基金资产净值	134,250,731.72	13,846,504.45
期末基金份额净值	1.0890	1.0837
注：1.本期已实现收益指基金本期利润收入，按摊余成本法计算，其他收入（不含公允价值变动损益）和除相关费用外的余额，本期利润为本期已实现收益加上未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为当期末余额，不是当期发生数）。		
3.所示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要低于所列数据。		

南方中债中期票据指数债券型发起式C

阶段	份额净值	份额净值增长率为	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率差	①-③	②-④
长率①	长率②	基准收益差③	基准收益差④	①-③	②-④	
过去三个月	1.17%	0.14%	0.78%	0.14%	0.39%	0.00%
过去六个月	2.64%	0.10%	1.51%	0.10%	1.13%	0.00%
过去一年	8.41%	0.09%	5.11%	0.08%	3.30%	0.01%
自基金合同生效日起至今	8.89%	0.08%	1.22%	0.08%	7.67%	0.00%

南方中债中期票据指数债券型发起式C

阶段	份额净值增长率为	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率差	①-③	②-④
长率①	长率②	基准收益差③	基准收益差④	①-③	②-④
过去三个月	1.10%	0.14%	0.78%	0.14%	0.32%
过去六个月	2.54%	0.10%	1.51%	0.10%	1.03%
过去一年	8.12%	0.09%	5.11%	0.08%	3.01%
自基金合同生效日起至今	8.37%	0.08%	1.22%	0.08%	7.15%

南方中债中期票据指数债券型发起式C

阶段	份额净值增长率为	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率差	①-③	②-④
长率①	长率②	基准收益差③	基准收益差④	①-③	②-④
过去三个月	1.10%	0.14%	0.78%	0.14%	0.32%
过去六个月	2.54%	0.10%	1.51%	0.10%	1.03%
过去一年	8.12%	0.09%	5.11%	0.08%	3.01%
自基金合同生效日起至今	8.37%	0.08%	1.22%	0.08%	7.15%

南方中债中期票据指数债券型发起式C

阶段	份额净值增长率为	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率差	①-③	②-④
长率①	长率②	基准收益差③	基准收益差④	①-③	②-④
过去三个月	1.10%	0.14%	0.78%	0.14%	0.32%
过去六个月	2.54%	0.10%	1.51%	0.10%	1.03%
过去一年	8.12%	0.09%	5.11%	0.08%	3.01%
自基金合同生效日起至今	8.37%	0.08%	1.22%	0.08%	7.15%

南方中债中期票据指数债券型发起式C

阶段	份额净值增长率为	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率差	①-③	②-④
长率①	长率②	基准收益差③	基准收益差④	①-③	②-④
过去三个月	1.10%	0.14%	0.78%	0.14%	0.32%
过去六个月	2.54%	0.10%	1.51%	0.10%	1.03%
过去一年	8.12%	0.09%	5.11%	0.08%	3.01%
自基金合同生效日起至今	8.37%	0.08%	1.22%	0.08%	7.15%

南方中债中期票据指数债券型发起式C

阶段	份额净值增长率为	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率差	①-③	②-④
长率①	长率②	基准收益差③	基准收益差④	①-③	②-④
过去三个月	1.10%	0.14%	0.78%	0.14%	0.32%
过去六个月	2.54%	0.10%	1.51%	0.10%	1.03%
过去一年	8.12%	0.09%	5.11%	0.08%	3.01%
自基金合同生效日起至今	8.37%	0.08%	1.22%	0.08%	7.15%

南方中债中期票据指数债券型发起式C

阶段	份额净值增长率为	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率差
----	----------	-----------	------------