

## 南方收益宝货币市场基金

## [2015] 第二季度报告

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:2015年7月18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2015年7月16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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	南方收益宝货币
交易代码	202047
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2014年12月16日
报告期末基金份额总额	316,138,655.55份

投资目标	本基金将采取积极的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在120天以内,在控制利率风险、合理配置资产的基础上,力争取得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将根据宏观经济形势、资金面情况、利率走势等多方面因素综合分析,将投资组合的平均剩余期限控制在120天以内,在控制利率风险、合理配置资产的基础上,力争取得超越业绩比较基准的收益。

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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

## § 3 主要财务指标

单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	2,168,746.68
2.本期利润	2,168,746.68
3.期末基金资产净值	316,138,655.55

注: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,由于货币市场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

## 3.2.1 报告期内基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率为(%)	净值收益率单利(%)	净值收益率单利(%)	净值收益率单利(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.059%	0.697%	0.3418%	0.6000%	0.7010%	0.0097%

注:本基金收益分配为按日结转份额。

## 3.2.2 自基金转型以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金转型日期为2014年12月16日。截至报告期末,本基金转型后基金合同生效未满一年。  
2、本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,建仓期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时间	离任日期	说明
夏威威	本基金基金经理	2014年12月15日	-	10月

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的行业自律规则,本基金期内,基金管理人整体合体操作合规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,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交易,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常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。为报告期内基金管理人所有的投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易或涉及交易所大宗交易的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4 报告期内基金持有人数或基金资产净值预说明

4.4.1 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.2 报告期内基金持有户数或基金资产净值预说明

4.4.3 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.4 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.5 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.6 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.7 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.8 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.9 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.10 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.11 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.12 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.13 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.14 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.15 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.16 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.17 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.18 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.19 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.20 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度,得益于政策的实质性宽松,货币市场利率呈现大幅下行,1年期政策性银行金融债和1年期AAA级信用等级下行100bp,货币市场利率在逐渐回归基本面的情况下,流动性运行以及相对稳定的汇率预期,使得交易双方在成交价格上出现明显分歧,特别是近期当成交量的5%的交易次数为0次,其中0次是由指数型基金根据标的指数成份股被调出而被动调整,1次是由投资组合的投资策略需要,相关投资组合经基金管理人提供决策依据并留存记录备查。

4.4.21 报告期内基金资产净值和份额统计表

第二季度