

# 南方理财14天债券型证券投资基金

基金管理人:南方基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2017年3月30日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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，并对其内容的准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。  
本基金公告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。  
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等，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及其更新。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称:南方理财14天债券A  
基金代码:200200

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2012-01-10

基金托管人:南方基金管理有限公司

基金管理人:中国工商银行股份有限公司

报告期末基金份额总额:1,026,234,307.00份

报告期末基金份额净值:981,434,740.00份

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“南方理财14天”。

2.2 基金产品说明

投资目标:本基金在资金安全、保持资产流动性的基础上，努力追求绝对收益，为基金的持有人带来资本增值。

投资策略:本基金采用积极的投资策略，利用货币市场的平滑操作机制在14个交易日内，在控制组合净值波动风险的前提下，通过配置组合内不同期限的货币市场工具，实现对货币市场基金的长期稳定收益。

业绩比较基准:银行存款利率(税后)+720个基点的超额回报率。

风险特征:本基金属于定期开放式基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目:基金管理人:南方基金管理有限公司;基金托管人:中国工商银行股份有限公司。

名称:姓名:魏立波

信息披露义务人:赵晓明 010-66106790

客户服务电话:400-889-8899

传真:0755-82768899 010-66106790

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址:<http://www.southfund.com>

基金年度报告备置地:基金管理人办公地址

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 利润表

2016年 2015年 2014年

南方理财14天南方理财14天南方理财14天

营业收入:26,274 10,561 7,777

营业成本:26,274 10,561 7,777

本期利润:36,686 -10,000 73,819

净利润:36,686 -10,000 73,819

营业收入净额:30,409% 347.20% 4,299.00%

净利润率:4.06% 3.47% 0.46%

本期利润:30,409% 347.20% 4,299.00%

净利润:30,409% 347.20% 4,299.00%

3.1.2 利润表

2016年末 2015年末 2014年末

南方基金南方基金南方基金

期末基金余额:1,026,234,307.00份

期末基金净值:981,434,740.00份

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

南方理财14天债券A

阶段:份额增长比例(%) 费用计提费率(%) 基金份额净值增长率(%) ①-③ ②-④

过去三个月:0.0000% 0.3460% 0.0000% 0.0474% 0.0000%

过去六个月:1.4075% 0.0044% 0.0024% 0.0765% 0.0044%

过去一年:3.0600% 0.0044% 0.1210% 0.0000% 0.0606%

过去两年:12.9400% 0.0000% 4.1966% 0.0000% 0.0591%

自基金合同生效起至今:19.2400% 0.0025% 6.1670% 0.0000% 0.0502%

注:本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期间集中支付。

2.本基金计算份额净值率时所选取的运作周期，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及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方理财14天债券A

阶段:份额增长比例(%) 费用计提费率(%) 基金份额净值增长率(%) ①-③ ②-④

过去三个月:0.0000% 0.3460% 0.0000% 0.0474% 0.0000%

过去六个月:1.4075% 0.0044% 0.0024% 0.0765% 0.0044%

过去一年:3.0600% 0.0044% 0.1210% 0.0000% 0.0606%

过去两年:12.9400% 0.0000% 4.1966% 0.0000% 0.0591%

自基金合同生效起至今:19.2400% 0.0025% 6.1670% 0.0000% 0.0502%

注:同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

南方理财14天债券A

年度:已分红次数 直接分红次数 累计分红次数 应付利润 累计利润 分配金额 备注

2016: 32,676,007份 3,731,701份 -23,374.26 36,589,234.74 7

2015: 64,499,069份 1,072,201份 -1,411,063.22 73,819,170.51 7

2014: 98,490,625份 4,397,302份 77,103,000 17,404,052.76 7

合计: 196,996,672份 41,620,494份 -1,764,212份 236,712,893份 7

单位:人民币元

南方理财14天债券B

年度:已分红次数 直接分红次数 累计分红次数 应付利润 累计利润 分配金额 备注

2016: 2,204,380份 239,672份 19,903,074.09 7

2015: 13,836,701份 1,358,265份 -4,642.00 15,486,364.85 7

2014: 13,630,411份 4,397,302份 77,103,000 17,404,052.76 7

合计: 44,016,138份 5,717,957份 52,776,197.80 7

单位:人民币元

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理的基本经验

基金管理公司成立于2004年，成为业内首批规范的基金管理公司之一，成为行业内的领航者。

南方基金总资产3亿元人民币。股东结构为:华泰证券股份有限公司(45%)；深圳市投资控股有限公司(30%)；厦门国际信托有限公司(15%)；深圳国投创新有限公司(10%)。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳设有子公司——南方东英资产管理有限公司。

基金管理公司已通过ISO9001质量管理体系认证。

4.1.2 基金经理的管理经验

基金经理的管理经验均在5年以上，具备丰富的投资管理经验。

4.2 管理人对报告期内基金运作合规性情况的说明

基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、基金合同和中国证监会的行政规章及其他有关规定，勤勉尽责地履行基金管理职责，未因基金管理人主观故意或过失而违反相关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

本基金在报告期内实现了较高的收益，体现了本基金的管理能力。

4.4 管理人对报告期末基金的投资策略和运作分析

本基金在报告期内主要通过配置短期利率债、高等级信用债、货币基金等资产，实现了较高的收益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金在报告期内对宏观经济、证券市场及行业走势进行了分析，认为宏观经济将保持平稳增长，证券市场将维持震荡上行趋势。

4.6 管理人对基金未来业绩的展望

本基金在报告期内对基金未来业绩进行了展望，认为本基金将继续保持较好的投资回报。

4.7 管理人对报告期内基金的估值政策和程序的说明

本基金在报告期内对基金的估值政策和程序进行了说明。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值变动情况的说明

本基金在报告期内对基金持有人数或基金资产净值变动情况进行了说明。

4.9 报告期内管理人对本基金利润分配情况的说明

本基金在报告期内对本基金利润分配情况进行了说明。

4.10 管理人对本基金未来业绩的展望

本基金在报告期内对本基金未来业绩进行了展望。

4.11 管理人对本基金的风险评价

本基金在报告期内对本基金的风险评价进行了说明。

4.12 管理人对本基金的流动性风险评价

本基金在报告期内对本基金的流动性风险评价进行了说明。

4.13 管理人对本基金的风险准备金计提情况

本基金在报告期内对本基金的风险准备金计提情况进行了说明。

4.14 管理人对本基金的关联交易的说明

本基金在报告期内对本基金的关联交易进行了说明。

4.15 管理人对本基金的会计政策、会

计估计和财务报表的说明

本基金在报告期内对本基金的会计政策、会计估计和财务报表进行了说明。

4.16 管理人对本基金的内部控制制度的说明

本基金在报告期内对本基金的内部控制制度进行了说明。

4.17 管理人对本基金的公平交易制度的说明

本基金在报告期内对本基金的公平交易制度进行了说明。

4.18 管理人对本基金的内部控制制度的说明

本基金在报告期内对本基金的内部控制制度进行了说明。

4.19 管理人对本基金的压力测试情况的说明

本基金在报告期内对本基金的压力测试情况进行了说明。

4.20 管理人对本基金的估值政策和程序的说明

本基金在报告期内对本基金的估值政策和程序进行了说明。

4.21 管理人对本基金的会计政策、会

计估计和财务报表的说明

本基金在报告期内对本基金的会计政策、会计估计和财务报表进行了说明。

4.22 管理人对本基金的内部控制制度的说明