

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
报告送出日期:2017年10月25日

基金管理人的董事会及高级管理人员所获得不存在虚假记载、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:中国工商银行股份有限公司根据基金合同约定，于2017年10月23日核销了本报告中的财务指标、净值表现、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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告书日期为2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金名称:南方理财14天债券型证券投资基金
基金代码:202003
基金托管方式:银行托管
基金合同生效日:2010年1月10日
报告期末基金资产总额:6,119,112,006.00元

本基金在追求资产的增值的同时，努力追求绝对收益，为基金份额持有人带来资产的增值。

投资目标:本基金采用积极管理的策略，积极投资于平均剩余期限在124天以内，以短期利率债、信用债、货币市场基金等品种构成的债券组合，并满足流动性的情况下，提高组合的流动性。

投资策略:本基金的债券投资策略为:七五分利策略。

风险收益特征:本基金为货币基金中的低风险品种，其长期平均风险和预期收益较低。

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

下属分级基金的基金简称:南方理财14天债券A
报告期末A类基金资产净值:202030
报告期末A类基金资产净值的份额:1,146,439,146.01份
3,506,473,740.30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，可简称为“南方理财14天”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年07月01日 - 2017年09月30日)

南方理财14天债券A 17,976,703.74 14,816,569.63

南方理财14天债券B 17,976,703.74 14,816,569.63

期末基金资产净值 1,062,439,146.01份 3,496,473,749.38份

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

3.2.1 本期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

南方理财14天债券A ① -0.3% ② -0.4%

过去三个月 1.015% 0.001% 0.346% 0.000% 0.0122% 0.0017%

南方理财14天债券B ① -0.2% ② -0.4%

过去三个月 1.015% 0.001% 0.346% 0.000% 0.0122% 0.0017%

注:1.本期报告期以日均收益扣除费用后，并在运作周期末集中支付。2.本期基金每份额净值计算日当期收益扣除费用后，并在运作周期末集中支付。3.本期基金每份额净值计算日当期收益扣除费用后，并在运作周期末集中支付。4.本期基金每份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.3 主要财务指标

报告期(2017年07月01日 - 2017年09月30日)

南方理财14天债券A 17,976,703.74 14,816,569.63

南方理财14天债券B 17,976,703.74 14,816,569.63

期末基金资产净值 1,062,439,146.01份 3,496,473,749.38份

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。

3.4 基金净值表现

3.4.1 本期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

南方理财14天债券A ① -0.3% ② -0.4%

过去三个月 1.015% 0.001% 0.346% 0.000% 0.0122% 0.0017%

南方理财14天债券B ① -0.2% ② -0.4%

过去三个月 1.015% 0.001% 0.346% 0.000% 0.0122% 0.0017%

注:1.本期报告期以日均收益扣除费用后，并在运作周期末集中支付。2.本期基金每份额净值计算日当期收益扣除费用后，并在运作周期末集中支付。3.本期基金每份额净值计算日当期收益扣除费用后，并在运作周期末集中支付。4.本期基金每份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期不存在异常交易行为。本报告期基金管理人管理的所有投资组合不存在与该交易对象进行交易较少的双边报价且连续三个交易日以上的股票买卖行为。

3.4.3 公平交易专项说明

3.4.1 公平交易制度执行情况

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度》有关规定，完善内控制度，确保公平交易制度的严格执行，公平对待旗下所有投资组合。

3.4.2 公平交易制度执行情况的专项说明

本基金于本报告期不存在异常交易行为。本报告期基金管理人管理的所有投资组合不存在与该交易对象进行交易较少的双边报价且连续三个交易日以上的股票买卖行为。

3.4.3 公平交易制度执行情况的专项说明

本基金于本报告期不存在异常交易行为。本报告期基金管理人管理的所有投资组合不存在与该交易对象进行交易较少的双边报价且连续三个交易日以上的股票买卖行为。

3.4.4 报告期内基金的投向和行业分类说明

3.5 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.1 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.2 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.3 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.4 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.5 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.6 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.7 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.8 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.9 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.10 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.11 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.12 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.13 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.14 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.15 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.16 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.17 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.18 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.19 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.20 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.21 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.22 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.23 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.24 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.25 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.26 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.27 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.28 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.29 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.30 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.31 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.32 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.33 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.34 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.35 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.36 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.37 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.38 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.39 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.40 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.41 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.42 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.43 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.44 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.45 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.46 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.47 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.48 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.49 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.50 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.51 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.52 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.53 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.54 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.55 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.56 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.57 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.58 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.59 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.60 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.61 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.62 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.63 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.64 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.65 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.66 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.67 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.68 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.69 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.70 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.71 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.72 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.73 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.74 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.75 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.76 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.77 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.78 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.79 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.80 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.81 报告期内基金的投向和行业分类

3.5.82 报告期内基金的