南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	南方中证500ETF联接(LOF)
交易代码	160119
前端交易代码	160119
后端交易代码	160120
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2009年9月25日
报告期末基金份额总额	3,745,740,820.72份
投资目标	本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,以中证500ETF作为其主要投资标的。为实现投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF,其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

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500”。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	南方中证500ETF
基金主代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年2月6日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年3月15日
基金管理人名称	南方基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数,本基金标的指数为中证500指数。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数,以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	137,612,955.54
2.本期利润	947,365,377.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.2274
4.期末基金资产净值	4,471,313,965.06
5.期末基金份额净值	1.1937

注:1.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;

2.所述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字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长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①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	24.14%	0.91%	23.88%	0.91%	0.26%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

注:本基金建仓期为基金备案生效之日起3个月,建仓期末本基金各项资产配置比例达到基金合同的约定。

§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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金的基金经理	2013年4月22日	-	8	女,美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士,具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国Open Link Financial公司、摩根斯坦利公司,从事量化分析工作。2008年9月加入南方基金,任南方基金数量化投资部基金经理助理;2013年4月至今,任南方500基金经理;2013年4月至今,任南方500ETF基金经理;2013年5月至今,任南方300基金经理;2013年5月至今,任南方开元沪深300ETF基金经理;2013年5月至今,任南方策略基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本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、中国证监会和《南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合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,本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控制交易公平执行,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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为2次,是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,随着稳增长、微刺激"政策的持续出台,经济企稳质量将得到明显改善,短期经济数据反复并不改变市场反弹走势。年底前沪港通即将开通,海外资金将加大对A股的配置力度,市场底部支撑较为扎实,个股和权块机会不断涌现,期间中证500指数涨25.25%。

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”等,将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平,并通过严格的风险管理流程,确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下:

① 接受申购/赎回所带来的股票仓位偏离,对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化;

② 本基金大额换购目标ETF所带来的成份股权重偏离,对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对;

③ 个别长期停牌证券,引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自本基金建仓完毕至报告期末,年化跟踪误差为0.390%,较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过4%的投资目标。

截至报告期末,本基金份额净值为1.1937元,报告期内,份额净值增长率为24.14%,同期业绩基准增长率为23.88%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	44,774,731.80	0.99
	其中:股票	44,774,731.80	0.99
2	基金投资	4,234,457,379.35	93.98
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	217,648,820.98	4.83
8	其他资产	9,102,625.69	0.20
9	合计	4,505,983,557.82	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	675,015.12	0.02
B	采矿业	1,148,856.64	0.03
C	制造业	28,244,151.29	0.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	832,844.18	0.02
E	建筑业	1,202,169.97	0.03
F	批发和零售业	2,646,635.93	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,140,570.87	0.03
H	住宿和餐饮业	57,680.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,626,068.09	0.08
J	金融业	666,937.32	0.01
K	房地产业	2,699,125.82	0.06
L	租赁和商务服务业	599,621.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	161,910.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	345,503.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	417,985.38	0.01
S	综合	309,657.19	0.01
	合计	44,774,731.80	1.00

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600978	宜华木业	279,000	1,431,270.00	0.03
2	600685	广船国际	65,370	1,119,788.10	0.03
3	601519	大智慧	171,030	1,022,759.40	0.02
4	600570	恒生电子	18,000	759,240.00	0.02
5	600740	山西焦化	124,400	722,764.00	0.02
6	600490	鹏欣资源	32,184	548,415.36	0.01
7	600112	天成控股	30,200	485,918.00	0.01
8	600201	金宇集团	10,335	362,448.45	0.01
9	002153	石基信息	4,700	329,799.00	0.01
10	002005	德豪润达	37,500	305,625.00	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	500ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理有限公司	4,234,457,379.35	94.70

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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、处罚的情形。

5.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	508,584.95
2	应收证券清算款	541,478.34
3	应收股利	1,691.14
4	应收利息	28,161.08
5	应收申购款	8,022,710.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,102,625.69

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600978	宜华木业	1,431,270.00	0.03	临时停牌
2	600685	广船国际	1,119,788.10	0.03	临时停牌
3	601519	大智慧	1,022,759.40	0.02	临时停牌
4	600740	山西焦化	722,764.00	0.02	临时停牌
5	600112	天成控股	485,918.00	0.01	临时停牌
6	600201	金宇集团	362,448.45	0.01	临时停牌
7	002005	德豪润达	305,625.00	0.01	临时停牌

注:本基金本报告期末前十名股票中除上述股票外不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,650,667,836.59
报告期期间基金总申购份额	582,122,533.09
减:报告期期间基金总赎回份额	1,487,049,548.96
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,745,740,820.72

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同。

2.南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)托管协议。

3.南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2014年第3季度报告原文。

8.2 存放地点

深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com

南方永利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

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:2014年10月24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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方永利1年定期开放债券(LOF)	
场内简称	南方永利	
交易代码	160130	
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)	
基金合同生效日	2013年4月25日	
报告期末基金份额总额	316,471,167.97份	
投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,在非开放期期间原则上组合久期与初始非开放期适当匹配的基础上,实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券组合投资收益。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:一年期定期存款税后收益率+1.2%。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,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。	
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	
下属两级基金的基金简称	南方永利1年定期开放债券(LOF)A	南方永利1年定期开放债券(LOF)C
下属两级基金的交易代码	160130	160132
报告期末下属两级基金的份额总额	314,920,994.16份	1,550,173.81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“南方永利”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)	
	南方永利1年定期开放债券(LOF)A	南方永利1年定期开放债券(LOF)C
1.本期已实现收益	13,796,351.00	66,263.63
2.本期利润	24,572,268.02	119,366.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0781	0.0770
4.期末基金资产净值	354,380,307.36	1,744,996.67
5.期末基金份额净值	1.125	1.126

注:1.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;

2.所述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字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

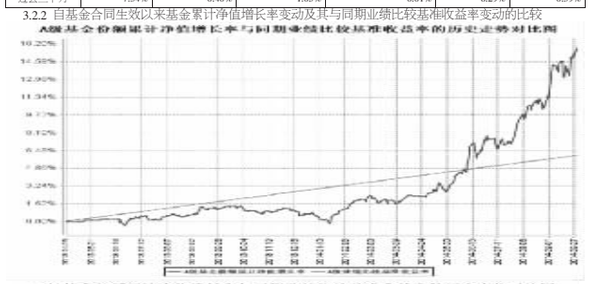
南方永利1年定期开放债券(LOF)A

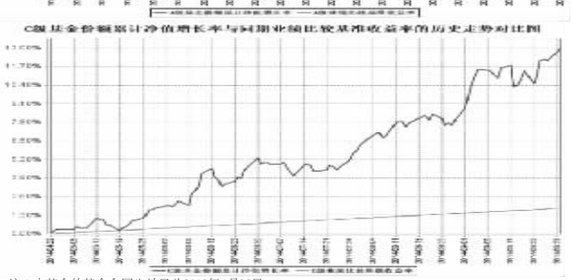
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.45%	0.40%	1.01%	0.01%	6.44%	0.39%

南方永利1年定期开放债券(LOF)C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.34%	0.40%	1.05%	0.01%	6.29%	0.39%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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





注:1.本基金的基金合同生效日为2013年4月25日;

2.本基金自2014年4月28日起增加C类收费模式,原有收费模式称为A类。

3.本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定

§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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩亚庆	本基金基金经理,固定收益部执行总监	2013年4月25日	-	14	经济学硕士,具有基金从业资格。2000年开始从事固定收益类证券承销、研究与投资管理,曾任职于国家开发银行资金局、全国社会保障基金理事会投资部。2008年加入南方基金,2010年5月至今,担任固定收益部副总监、执行总监;2008年11月至今,任南方现金基金经理;2010年11月至今,任南方广利基金经理;2013年4月至今,任南方永利基金经理。

注:1.对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期,对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本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、中国证监会和《南方永利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合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,本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控制交易公平执行,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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为2次,是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

第三季度,国内经济在经历了第二季度的持稳反弹后,经济数据自7月份起开始向下回落,8月的工业增加值和发电量数据为2009年的低点,地产销售和投资数据也非常疲弱,社会融资和信贷出现缩量,经济向下的趋势明显。9月份起,政府在货币政策、房地产和基建投资方面重新转入刺激,货币政策以SLF、下调央票发行利率为手段,推动了债券市场在9月份的超预期上涨,利率倒收益水平在9月创下年内新低,信用债以城投债为代表也出现进一步上涨。债市今年经历了连续三个季度的上涨。从主要债券指数看,中债综合财富数上涨1.65%,中债企债财富指数上涨2.32%。权益市场在第三季度出现大涨,在经济数据不利的情况下,对沪港通、十八届四中全会以及对政府在改革和创新方面的正面预期支持了市场不断上涨,从主要权益指数看,沪深300指数上涨13.2%,中证转债指数上涨5.30%,中小板和创业板指数分别上涨16.90%和上涨9.69%。

永利基金第二季度在债券投资中基本以信用债持仓为主,获取了债市上涨收益,季末降低了部分仓位。在可转债投资上,第三季度基本保持了高仓位,并对持仓的品种进行动态调整,在季末较大比例降低了可转债仓位,并对转债转股和部分定增流通后的股票进行了卖出操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金A级净值增长率为7.45%,本报告期基金C级净值增长率为7.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,我们认为经历了8月份的经济低点后,经济会出现回升,但回升的幅度和持续性仍会有限,债券市场会受到短期经济数据回暖,和降低社会融资成本总要求以及央行的创新调控手段等的共同影响,由于第三季度债市涨幅较大,第四季度收益率会出现反复,收益率总体会以区间震荡为主。第三季度权益市场出现了大幅上涨,很难用经济基本面来解释,制度设计和政策预期是主要原因,第四季度我们将会更多尊重投资规律、基金属性和绝对回报要求,相对于第三季度实际操作上的乐观和坚持,第四季度我们将更注重防守和实现收益,并在年末积极思考和布局明年的投资。永利基金将继续以经济、政策和市场三者关系为研究分析重点,将在最新市场环境下通过大类资产选择和配置,建立多策略和总回报投资思路,在控制基金下行风险的基础上,为基金积极创造正收益来源,为投资者累积正回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	24,628,241.64	4.19
	其中:股票	24,628,241.64	4.19
2	固定收益投资	502,004,808.80	85.38
	其中:债券	502,004,808.80	85.38
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	52,253,634.23	8.89
7	其他资产	9,047,567.57	1.54
8	合计	587,934,252.24	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	15,426,902.49	4.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,430.00	0.00
E	建筑业	3,764,596.70	1.06
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,690,096.85	0.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,743,215.60	1.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	24,628,241.64	6.92

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002236	大华股份	266,357	7,343,462.49	2.06
2	601989	中国重工	585,267	3,839,351.52	1.08
3	600820	隧道股份	617,147	3,764,596.70	1.06
4	002065	东华软件	178,930	3,743,215.60	1.05
5	002185	华天科技	212,903	2,801,803.48	0.79
6	000099	中信海直	140,257	1,690,096.85	0.47
7	600703	三安光电	92,250	1,396,665.00	0.39
8	603806	福斯特	1,000	45,620.00	0.01
9	601016	节能风电	1,000	3,430.00	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,930,000.00	3.07
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	346,939,453.20	97.42
5	企业短期融资券	10,146,000.00	2.85
6	中期票据	20,309,000.00	5.70
7	可转债	113,680,355.60	31.92
8	其他	-	-
9	合计	502,004,808.80	140.96

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122207	12路桥集	308,340	30,772,332.00	8.64
2	122661	12环化债	284,290	29,654,289.90	8.33
3	124307	13宏运开	299,970	29,097,090.00	8.17
4	122155	12天富债	280,000	27,997,200.00	7.86
5	122641	12武进债	250,110	25,261,110.00	7.09

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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、处罚的情形。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	411,694.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,635,872.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,047,567.57

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110022	同仁转债	15,417,107.30	4.33
2	128003	华天转债	12,096,488.29	3.40
3	128004	久立转债	10,460,504.74	2.94
4	110018	国电转债	8,916,112.80	2.50
5	128002	东华转债	5,660,713.28	1.59
6	113003	重工转债	5,355,917.60	1.50
7	110011	歌华转债	5,290,219.20	1.49
8	110012	海运转债	2,742,842.30	0.77
9	127002	徐工转债	2,484,371.60	0.70
10	110024	隧道转债	1,087,660.80	0.31
11	113001	中行转债	358,317.60	0.10
12	113005	平安转债	28,457.00	0.01

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002065	东华软件	3,743,215.60	1.05	重大资产重组
2	600703	三安光电	1,396,665.00	0.39	非公开发行

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	南方永利1年定期开放债券(LOF)A	南方永利1年定期开放债券(LOF)C
报告期期初基金份额总额	314,142,986.54	1,550,173.81
报告期期间基金总申购份额	778,007.62	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	314,920,994.16	1,550,173.81

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

注:基金管理人未持有本基金份额。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.南方永利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)基金合同

2.南方永利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)托管协议

3.南方永利1年定期开放债券型证券投资基金2014年第3季度报告原文

8.2 存放地点

深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦31-33层

8.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com

南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方稳利1年定期开放债券	
交易代码	000086	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年7月23日	
报告期末基金份额总额	3,151,779,012.25份	
投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券组合投资收益。	
业绩比较基准	一年期定期存款税后收益率×140%。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,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。	
基金管理人	南方基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	南方稳利1年定期开放债券A	南方稳利1年定期开放债券C
下属两级基金的交易代码	000086	000720
报告期末下属两级基金的份额总额	3,007