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 第四季度 报告

2014年12月31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：2015年1月22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2015年1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10月1日起至2014年12月31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)
场内简称	南方500
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	3,178,886,245.80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，紧跟标的指数，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0.35%，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匹配的风险收益特征。
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匹配的风险收益特征。

§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10月1日 - 2014年12月31日）
1.本期已实现收益	259,211,060.89
2.本期利润	317,253,749.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0906
4.期末基金资产净值	3,981,924,887.50
5.期末基金份额净值	1.2526

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；

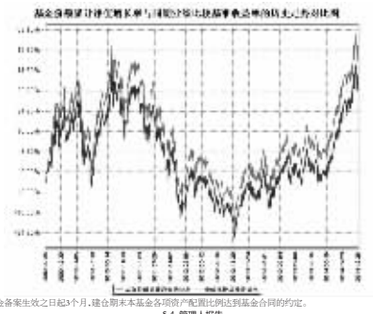
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	7.66%	1.39%	7.88%	1.37%	-0.22%	0.02%

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	本基金基金经理	2013年4月22日	-	9年	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；2014年10月至今，任500ETF联接基金经理。

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1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，央行降息降低经济融资成本，刺激经济回升，降息时间超出市场预期，对股市形成利好，期间中证500指数涨8.27%。

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差日因子分析系统”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日因子分析如下：

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 本基金大额热购日指和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 12月中，我们根据指数每半年度成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

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0.389%，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1.2526元，报告期内，份额净值增长率为7.66%，同期业绩基准增长率为7.88%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	25,800,381.58	0.64
	其中：股票	25,800,381.58	0.64
2	基金投资	3,757,868,383.57	92.92
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	216,003,083.01	5.34
8	其他资产	44,409,110.08	1.10
9	合计	4,044,080,958.24	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	238,622.70	0.01
B	采矿业	571,421.88	0.01
C	制造业	13,421,676.92	0.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	409,032.16	0.01
E	建筑业	464,256.65	0.01
F	批发和零售业	2,190,203.91	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,167,587.18	0.03
H	住宿和餐饮业	512,244.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,305,455.27	0.06
J	金融业	348,937.54	0.01
K	房地产业	3,055,011.61	0.08
L	租赁和商务服务业	203,650.90	0.01
M	科学研究和技术服务业	52,663.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	95,348.00	0.00
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	624,457.16	0.02
S	综合	139,812.70	0.00
	合计	25,800,381.58	0.65

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	601519	大智慧	267,330	1,598,633.40	0.04
2	600240	华业地产	121,779	1,216,572.21	0.03
3	600584	长电科技	92,900	1,033,977.00	0.03
4	600704	物产中大	85,576	888,278.88	0.02
5	300412	迦南科技	36,150	707,817.00	0.02
6	600580	卧龙电气	61,200	641,376.00	0.02
7	600458	时代新材	51,060	621,910.80	0.02
8	600575	皖江物流	132,100	542,931.00	0.01
9	600754	锦江股份	20,400	512,244.00	0.01
10	000977	浪潮信息	12,400	510,632.00	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	3,757,868,383.57	94.37

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	436,003.20
2	应收证券清算款	5,468,781.49
3	应收股利	1,691.14
4	应收利息	33,960.90
5	应收申购款	38,468,673.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,409,110.08

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	601519	大智慧	1,598,633.40	0.04	临时停牌
2	600584	长电科技	1,033,977.00	0.03	临时停牌
3	600704	物产中大	888,278.88	0.02	临时停牌
4	600580	卧龙电气	641,376.00	0.02	临时停牌
5	600458	时代新材	621,910.80	0.02	临时停牌
6	600575	皖江物流	542,931.00	0.01	临时停牌
7	600754	锦江股份	512,244.00	0.01	临时停牌
8	000977	浪潮信息	510,632.00	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	3,745,740,820.72
报告期期间基金总申购份额	536,958,930.71
减:报告期期间基金总赎回份额	1,103,813,505.63
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	3,178,886,245.80

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	38,304,604.31
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期末管理人持有的本基金份额	38,304,604.31
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.20

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2014年12月19日	38,304,604.31	50,000,000.00	-
合计			38,304,604.31	50,000,000.00	-

注：基金管理人固有资金投资适用费率为每笔1000元。

§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4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 第四季度 报告

2014年12月31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：2015年1月22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2015年1月20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10月1日起至12月31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	318,835,106.44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，在步开放期期间原则上组合久期与初始步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A/年定期开放债券（LOF）A　　南方永利B/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	317,284,210.75份　　1,550,895.69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10月1日 - 2014年12月31日）	
	南方永利A/年定期开放债券（LOF）A	南方永利B/年定期开放债券（LOF）C
1.本期已实现收益	44,591,651.62	216,573.10
2.本期利润	83,554,621.79	406,966.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.2638	0.2624
4.期末基金资产净值	427,625,069.95	2,090,751.61
5.期末基金份额净值	1.348	1.348

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

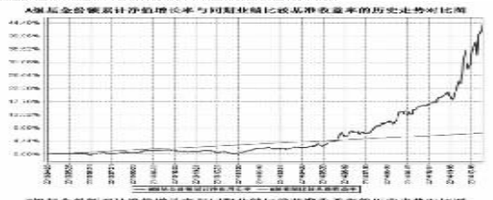
南方永利A/年定期开放债券（LOF）A

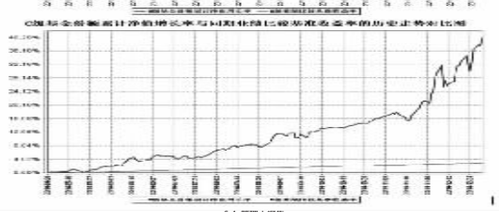
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	24.29%	1.17%	1.00%	0.01%	23.29%	1.16%

南方永利B/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	24.07%	1.18%	1.04%	0.01%	23.03%	1.17%

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





§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、固定收益部总监	2013年4月25日	-	14年	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、研发与投资管理，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，历任固定收益部副总监、执行总监。2014年12月至今，担任固定收益部总监；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、《南方理财30天债券型证券投资基金基金合同》和《南方永利1年定期开放债券型证券投资基金合同》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0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

2014年四季度基本面整体对债券市场有利，受到固定资产投资和房地产投资完成额累计同比继续下行的影响，经济增速继续探底。房地产和制造业投资继续萎缩，基建投资继续担任对冲角色，累计同比增速仍处于高位。价格方面，CPI整体继续回落，非食品CPI受到原油价格下跌影响下跌明显。PPI已连续34个月同比为负，并且幅度正在扩大。政策方面，央行四季度逐步减少公开市场资金投放，通过MLF继续投放流动性。下调正回购利率，并于11月21日不对称降息。汇率方面10月份以来人民币开始出现贬值，货币政策最在放松空间被抑制。“43号文”的出台严格限制了地方政府债务扩张，融资需求继续低迷，市场方面，债券收益率11月份出现了今年以来的最大降幅，随后受到中登结押回购新规的影响，收益率又出现显著反弹，资金面也随着临近年末，新股扎动，央行仅部分续作MLF等因素出现紧张。股票市场走出底部，截止2014年末上证综指累计涨幅超过30%，对货币基金规模造成了一定冲击。4季度南方理财30天债券为投资收益，基金规模出现较大波动，操作上基金更加注重流动性的安排，以增加剩余期限较短的短融和短期存款配置为主，并配合逆回购操作以保持基金的流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

南方理财30天债券型证券投资基金A级基金在2014年10月01日至2014年12月14日的净值收益率为0.9183%，同期业绩比较基准收益率为0.2816%；B级基金在2014年10月01日至2014年11月26日的净值收益率为0.7327%，同期业绩比较基准收益率为0.2140%。

南方收益宝货币市场基金在本报告期（2014年12月15日 — 2014年12月31日）的净值收益率为0.1813%，同期业绩比较基准收益率为0.0638%。

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2015年一季度，经济增速中枢较2014年明确下沿份，进入“新常态”。基建投资仍是保增长的重要筹码，房地产投资能否回升有待检验，制造业投资预计将继续下滑，美元持续走强的背景下，新兴市场货币将继续面临贬值压力，央行货币政策施展空间有限，原油价格为代表的大宗商品继续走熊，带动CPI在一季度保持低位，PPI仍将持续为负，实体经济资金需求疲弱，地方政府平台类的融资需求受“43号文”的束也将得到限制，整体看资金利率有下行动力，但央行货币政策较去年有所收紧。春节前货币市场还将受到新股冲击、缴税、春节取现因素以及MLF到期等影响，短期内利率难以回落，南方收益宝将维持适中久期，保持对短融和银行存款的重点配置，适当配置浮息债和逆回购，在保持基金良好流动性的同时提高静态收益，同时积极灵活把握市场波段操作，我们将密切跟踪经济走势、政策和资金面的情况，保持“稳健有序、积极主动”的管理风格，争取为投资者创造理想的回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

转型后：南方收益宝货币市场基金

报告期（2014年12月15日 — 2014年12月31日）

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	固定收益投资	149,993,246.52	50.30
	其中：债券	149,993,246.52	50.30
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	96,758,385.14	32.46
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	48,482,853.80	16.26
4	其他资产	2,926,371.37	0.98
5	合计	298,120,856.83	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	7.72
	其中：买断式回购融资	-
序号	项目	金额　　占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	22,999,645.50　　8.37
	其中：买断式回购融资	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	107
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	97

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注：本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	51.79	8.37
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	3.64	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	3.64	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	13.84	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天（含）	34.58	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		107.48	8.37

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	摊余成本（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	14,948,000.00	5.44
	其中：政策性金融债	14,948,000.00	5.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	135,085,000.00	49.19
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	150,033,000.00	54.63
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按剩余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	041458078	14川投CP002	200,000	19,984,004.77	7.28
2	011416004	14华电SCP004	200,000	19,972,822.85	7.27
3	011474003	14兖煤SCP003	100,000	10,047,058.52	3.66
4	041362046	14九龙江CP001	100,000	10,018,954.50	3.65
5	140207	14国开07	100,000	10,010,679.19	3.64
6	041451037	14西投CP001	100,000	10,000,246.27	3.64
7	041460070	14三峡化工CP001	100,000	10,000,087.31	3.64
8	011410009	14中电投SCP009	100,000	9,999,340.01	3.64
9	041464062	14欧亚CP002	100,000	9,997,302.96	3.64
10	041458003	14圣农CP001	100,000	9,997,073.52	3.64

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0290%
报告期内偏离度的最低值	-0.1111%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0438%

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金采用“摊余成本法”计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

5.8.2

本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,906,371.37
4	应收申购款	20,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,926,371.37

转型前：南方理财30天债券型证券投资基金

报告期（2014年10月1日 — 2014年12月14日）

5.9 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	固定收益投资	149,969,163.65	44.08
	其中：债券	149,969,163.65	44.08
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	62,968,414.45	18.51
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	114,139,963.41	33.55
4	其他资产	13,144,782.58	3.86
5	合计	340,222,324.09	100.00

5.10 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	8.92
	其中：买断式回购融资	-
序号	项目	金额　　占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	20,999,789.50　　6.65
	其中：买断式回购融资	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.11 基金投资组合平均剩余期限

5.11.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	108
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	140
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	82

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注：本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过150天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.11.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	51.94	6.65
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	6.33	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	15.19	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天（含）	30.06	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		103.51	6.65

5.12 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（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	24,949,000.00	7.90
	其中：政策性金融债