

南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金

2014 年度报告摘要

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:中国银行股份有限公司
送出日期:2015年3月26日
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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

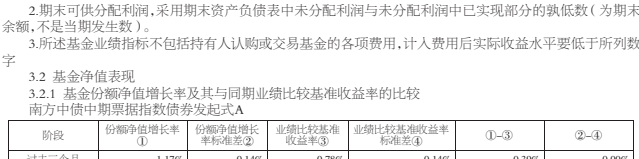
Table with 2 columns: Item and Content. Includes sections for 2.1 Basic Information (基金基本情况), 2.2 Products (基金产品目录), and 2.3 Management and Trustees (基金管理和基金托管人).

Table with 2 columns: Item and Content. Section 2.4 Disclosure Method (信息披露方式), listing contact information for the fund manager and custodian.

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

Table with 2 columns: Item and Content. Section 3.1 Main Financial Indicators, showing performance metrics for 2014 and 2013.

3.2 基金净值表现
3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 基金投资组合报告
3.3.1 基金投资组合报告
3.3.2 基金投资组合报告
3.3.3 基金投资组合报告

Table with 2 columns: Item and Content. Section 3.3.1 Fund Portfolio Report, detailing asset allocation and top holdings.

Table with 2 columns: Item and Content. Section 3.3.2 Fund Portfolio Report, detailing asset allocation and top holdings.

Table with 2 columns: Item and Content. Section 3.3.3 Fund Portfolio Report, detailing asset allocation and top holdings.

3.3.4 基金投资组合报告
3.3.5 基金投资组合报告
3.3.6 基金投资组合报告

3.3.7 基金投资组合报告
3.3.8 基金投资组合报告
3.3.9 基金投资组合报告

3.3.10 基金投资组合报告
3.3.11 基金投资组合报告
3.3.12 基金投资组合报告

3.3.13 基金投资组合报告
3.3.14 基金投资组合报告
3.3.15 基金投资组合报告

3.3.16 基金投资组合报告
3.3.17 基金投资组合报告
3.3.18 基金投资组合报告

3.3.19 基金投资组合报告
3.3.20 基金投资组合报告
3.3.21 基金投资组合报告

3.3.22 基金投资组合报告
3.3.23 基金投资组合报告
3.3.24 基金投资组合报告

3.3.25 基金投资组合报告
3.3.26 基金投资组合报告
3.3.27 基金投资组合报告

3.3.28 基金投资组合报告
3.3.29 基金投资组合报告
3.3.30 基金投资组合报告

3.3.31 基金投资组合报告
3.3.32 基金投资组合报告
3.3.33 基金投资组合报告

3.3.34 基金投资组合报告
3.3.35 基金投资组合报告
3.3.36 基金投资组合报告

3.3.37 基金投资组合报告
3.3.38 基金投资组合报告
3.3.39 基金投资组合报告

3.3.40 基金投资组合报告
3.3.41 基金投资组合报告
3.3.42 基金投资组合报告

3.3.43 基金投资组合报告
3.3.44 基金投资组合报告
3.3.45 基金投资组合报告

3.3.46 基金投资组合报告
3.3.47 基金投资组合报告
3.3.48 基金投资组合报告

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,“离任日期”为根据合同约定确定的解聘日期,除首任基金经理外,“任职日期”和“离任日期”分别指根据合同约定确定的聘任日期和解聘日期。
2.2.2 基金合同生效以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

2.3 基金投资组合报告
2.3.1 基金投资组合报告
2.3.2 基金投资组合报告
2.3.3 基金投资组合报告

2.3.4 基金投资组合报告
2.3.5 基金投资组合报告
2.3.6 基金投资组合报告

2.3.7 基金投资组合报告
2.3.8 基金投资组合报告
2.3.9 基金投资组合报告

2.3.10 基金投资组合报告
2.3.11 基金投资组合报告
2.3.12 基金投资组合报告

2.3.13 基金投资组合报告
2.3.14 基金投资组合报告
2.3.15 基金投资组合报告

2.3.16 基金投资组合报告
2.3.17 基金投资组合报告
2.3.18 基金投资组合报告

2.3.19 基金投资组合报告
2.3.20 基金投资组合报告
2.3.21 基金投资组合报告

2.3.22 基金投资组合报告
2.3.23 基金投资组合报告
2.3.24 基金投资组合报告

2.3.25 基金投资组合报告
2.3.26 基金投资组合报告
2.3.27 基金投资组合报告

2.3.28 基金投资组合报告
2.3.29 基金投资组合报告
2.3.30 基金投资组合报告

2.3.31 基金投资组合报告
2.3.32 基金投资组合报告
2.3.33 基金投资组合报告

2.3.34 基金投资组合报告
2.3.35 基金投资组合报告
2.3.36 基金投资组合报告

2.3.37 基金投资组合报告
2.3.38 基金投资组合报告
2.3.39 基金投资组合报告

2.3.40 基金投资组合报告
2.3.41 基金投资组合报告
2.3.42 基金投资组合报告

2.3.43 基金投资组合报告
2.3.44 基金投资组合报告
2.3.45 基金投资组合报告

2.3.46 基金投资组合报告
2.3.47 基金投资组合报告
2.3.48 基金投资组合报告

2.3.49 基金投资组合报告
2.3.50 基金投资组合报告
2.3.51 基金投资组合报告

2.3.52 基金投资组合报告
2.3.53 基金投资组合报告
2.3.54 基金投资组合报告

2.3.55 基金投资组合报告
2.3.56 基金投资组合报告
2.3.57 基金投资组合报告

2.3.58 基金投资组合报告
2.3.59 基金投资组合报告
2.3.60 基金投资组合报告

2.3.61 基金投资组合报告
2.3.62 基金投资组合报告
2.3.63 基金投资组合报告

2.3.64 基金投资组合报告
2.3.65 基金投资组合报告
2.3.66 基金投资组合报告

2.3.67 基金投资组合报告
2.3.68 基金投资组合报告
2.3.69 基金投资组合报告

2.3.70 基金投资组合报告
2.3.71 基金投资组合报告
2.3.72 基金投资组合报告

2.3.73 基金投资组合报告
2.3.74 基金投资组合报告
2.3.75 基金投资组合报告

2.3.76 基金投资组合报告
2.3.77 基金投资组合报告
2.3.78 基金投资组合报告

2.3.79 基金投资组合报告
2.3.80 基金投资组合报告
2.3.81 基金投资组合报告

2.3.82 基金投资组合报告
2.3.83 基金投资组合报告
2.3.84 基金投资组合报告

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
本会计主体:南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

Table with 2 columns: Item and Content. Section 7.3.1 Fund Net Asset Value Statement, showing changes in net assets for 2014.

Table with 2 columns: Item and Content. Section 7.3.2 Fund Net Asset Value Statement, showing changes in net assets for 2013.

7.4 关联方关系及其交易的披露
7.4.1 关联方关系及其交易的披露
7.4.2 关联方关系及其交易的披露

7.4.3 关联方关系及其交易的披露
7.4.4 关联方关系及其交易的披露
7.4.5 关联方关系及其交易的披露

7.4.6 关联方关系及其交易的披露
7.4.7 关联方关系及其交易的披露
7.4.8 关联方关系及其交易的披露

7.4.9 关联方关系及其交易的披露
7.4.10 关联方关系及其交易的披露
7.4.11 关联方关系及其交易的披露

7.4.12 关联方关系及其交易的披露
7.4.13 关联方关系及其交易的披露
7.4.14 关联方关系及其交易的披露

7.4.15 关联方关系及其交易的披露
7.4.16 关联方关系及其交易的披露
7.4.17 关联方关系及其交易的披露

7.4.18 关联方关系及其交易的披露
7.4.19 关联方关系及其交易的披露
7.4.20 关联方关系及其交易的披露

7.4.21 关联方关系及其交易的披露
7.4.22 关联方关系及其交易的披露
7.4.23 关联方关系及其交易的披露

7.4.24 关联方关系及其交易的披露
7.4.25 关联方关系及其交易的披露
7.4.26 关联方关系及其交易的披露

7.4.27 关联方关系及其交易的披露
7.4.28 关联方关系及其交易的披露
7.4.29 关联方关系及其交易的披露

7.4.30 关联方关系及其交易的披露
7.4.31 关联方关系及其交易的披露
7.4.32 关联方关系及其交易的披露

7.4.33 关联方关系及其交易的披露
7.4.34 关联方关系及其交易的披露
7.4.35 关联方关系及其交易的披露

7.4.36 关联方关系及其交易的披露
7.4.37 关联方关系及其交易的披露
7.4.38 关联方关系及其交易的披露

7.4.39 关联方关系及其交易的披露
7.4.40 关联方关系及其交易的披露
7.4.41 关联方关系及其交易的披露

7.4.42 关联方关系及其交易的披露
7.4.43 关联方关系及其交易的披露
7.4.44 关联方关系及其交易的披露

7.4.45 关联方关系及其交易的披露
7.4.46 关联方关系及其交易的披露
7.4.47 关联方关系及其交易的披露

7.4.48 关联方关系及其交易的披露
7.4.49 关联方关系及其交易的披露
7.4.50 关联方关系及其交易的披露

7.4.51 关联方关系及其交易的披露
7.4.52 关联方关系及其交易的披露
7.4.53 关联方关系及其交易的披露

7.4.54 关联方关系及其交易的披露
7.4.55 关联方关系及其交易的披露
7.4.56 关联方关系及其交易的披露

7.4.57 关联方关系及其交易的披露
7.4.58 关联方关系及其交易的披露
7.4.59 关联方关系及其交易的披露

7.4.60 关联方关系及其交易的披露
7.4.61 关联方关系及其交易的披露
7.4.62 关联方关系及其交易的披露

7.4.63 关联方关系及其交易的披露
7.4.64 关联方关系及其交易的披露
7.4.65 关联方关系及其交易的披露

7.4.66 关联方关系及其交易的披露
7.4.67 关联方关系及其交易的披露
7.4.68 关联方关系及其交易的披露

7.4.69 关联方关系及其交易的披露
7.4.70 关联方关系及其交易的披露
7.4.71 关联方关系及其交易的披露

7.4.72 关联方关系及其交易的披露
7.4.73 关联方关系及其交易的披露
7.4.74 关联方关系及其交易的披露

7.4.75 关联方关系及其交易的披露
7.4.76 关联方关系及其交易的披露
7.4.77 关联方关系及其交易的披露

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购
截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额13,849,779.22元,是以如下债券作为抵押:

Table with 5 columns: Party Name, Bond Name, Repurchase Date, End Value, and Number of Shares. Section 7.4.5.3.2 Market Bond Repurchase.

8.1 期末基金资产组合情况
8.1.1 基金资产组合情况
8.1.2 基金资产组合情况

Table with 2 columns: Item and Content. Section 8.1.1 Fund Asset Portfolio, showing asset allocation for 2014.

Table with 2 columns: Item and Content. Section 8.1.2 Fund Asset Portfolio, showing asset allocation for 2013.

8.2 期末按行业分类的股票投资组合
8.2.1 基金本报告期末未持有股票
8.2.2 基金本报告期末未持有股票

8.3 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
8.3.1 基金本报告期末未持有股票
8.3.2 基金本报告期末未持有股票

8.4 报告期内投资股票的重大变动
8.4.1 基金本报告期末未持有股票
8.4.2 基金本报告期末未持有股票

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
8.5.1 基金本报告期末未持有债券
8.5.2 基金本报告期末未持有债券

Table with 2 columns: Item and Content. Section 8.5.1 Bond Portfolio, showing bond holdings for 2014.

Table with 2 columns: Item and Content. Section 8.5.2 Bond Portfolio, showing bond holdings for 2013.

8.6 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
8.6.1 基金本报告期末未持有债券
8.6.2 基金本报告期末未持有债券

Table with 2 columns: Item and Content. Section 8.6.1 Top 5 Bond Holdings, showing bond holdings for 2014.

Table with 2 columns: Item and Content. Section 8.6.2 Top 5 Bond Holdings, showing bond holdings for 2013.

8.7 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
8.7.1 基金本报告期末未持有资产支持证券
8.7.2 基金本报告期末未持有资产支持证券

8.8 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
8.8.1 基金本报告期末未持有贵金属
8.8.2 基金本报告期末未持有贵金属

8.9 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
8.9.1 基金本报告期末未持有权证
8.9.2 基金本报告期末未持有权证

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
8.10.1 基金本报告期末未持有股指期货
8.10.2 基金本报告期末未持有股指期货

8.11 投资股指期货情况
8.11.1 基金本报告期末未持有股指期货
8.11.2 基金本报告期末未持有股指期货

8.12 基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现在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、处罚的情况
8.12.1 基金本报告期末未持有股票
8.12.2 基金本报告期末未持有股票

8.12.3 基金本报告期末未持有股票
8.12.4 基金本报告期末未持有股票
8.12.5 基金本报告期末未持有股票

8.12.6 基金本报告期末未持有股票
8.12.7 基金本报告期末未持有股票
8.12.8 基金本报告期末未持有股票

8.12.9 基金本报告期末未持有股票
8.12.10 基金本报告期末未持有股票
8.12.11 基金本报告期末未持有股票

8.12.12 基金本报告期末未持有股票
8.12.13 基金本报告期末未持有股票
8.12.14 基金本报告期末未持有股票

8.12.15 基金本报告期末未持有股票
8.12.16 基金本报告期末未持有股票
8.12.17 基金本报告期末未持有股票

8.12.18 基金本报告期末未持有股票
8.12.19 基金本报告期末未持有股票
8.12.20 基金本报告期末未持有股票

8.12.21 基金本报告期末未持有股票
8.12.22 基金本报告期末未持有股票
8.12.23 基金本报告期末未持有股票

8.12.24 基金本报告期末未持有股票
8.12.25 基金本报告期末未持有股票
8.12.26 基金本报告期末未持有股票

8.12.27 基金本报告期末未持有股票
8.12.28 基金本报告期末未持有股票
8.12.29 基金本报告期末未持有股票

8.12.30 基金本报告期末未持有股票
8.12.31 基金本报告期末未持有股票
8.12.32 基金本报告期末未持有股票

8.12.33 基金本报告期末未持有股票
8.12.34 基金本报告期末未持有股票
8.12.35 基金本报告期末未持有股票