南方升元中短期利率债债券型证券投资基金（原南方理财14天债券型证券投资基金）2020年第2季度报告

2020年06月30日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2020年7月21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 2020 年 7 月 17 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。

原南方理财 14 天债券型证券投资基金本报告期自 2020 年 4 月 1 日起至 2020 年 6 月 15 日止，南方升元中短期利率债债券型证券投资基金本报告期自 2020 年 6 月 16 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	南方升元中短期利率债债券
基金主代码	009534
交易代码	009534
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 16 日
报告期末基金份额总额	272,616,594.69 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金将密切关注经济运行的质量与效率，把握领先指标，预测未来走势，深入分析国家推行的财政与货币政策对未来宏观经济运行以及投资环境的影响。本基金对宏观经济运行中的价格指数与中央银行的货币供给与利率政策研判将成为投资决策的基本依据，并作为债券组合的久期配置的依据。在宏观分析及其决定的久期配置范围下，本基金将进行类属配置以贯彻久期策略。对不同类属债券，本基金将对其收益和风险情况进行评估，评估其为组合提供持有期收益和价差收益的能力，同时关注其利率风险和流动性风险。

业绩比较基准	中债-固定利率债券全价（1-3 年）指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
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	南方升元中短期利率债债券 A	南方升元中短期利率债债券 C
下属分级基金的交易代码	009534	009535
报告期末下属分级基金的份额总额	272,616,494.69 份	100.00 份

注：1.基金管理人根据持有人大会决议，将投资者未赎回的原南方理财 14 天债券型证券投资基金 A 类和 B 类基金份额变更登记为南方升元中短期利率债债券型证券投资基金 A 类基金份额，对于上述实施变更登记的基金份额，其份额持有期在变更登记后仍连续计算。

2.本基金从 2020 年 6 月 16 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2020 年 6 月 18 日起存续。

2.2 基金基本情况（转型前）

基金简称	南方理财 14 天债券	
基金主代码	202303	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 8 月 14 日	
报告期末基金份额总额	288,624,275.03 份	
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，努力追求绝对收益，为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。	
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在 134 天以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金。	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
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	南方理财 14 天债券 B
下属分级基金的交易代码	202303	202304
报告期末下属分级基金的份额总额	273,472,386.59 份	15,151,888.44 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”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 6 月 16 日－2020 年 6 月 30 日）	
	南方升元中短期利率债债券 A	南方升元中短期利率债债券 C
1.本期已实现收益	256,103.32	0.11
2.本期利润	514,621.04	0.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0018	0.0026
4.期末基金资产净值	273,124,241.86	100.22
5.期末基金份额净值	1.0019	1.0022

注：1、上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；

2、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。

3、自 2020 年 6 月 16 日起原南方理财 14 天债券型证券投资基金转型为南方升元中短期利率债债券型证券投资基金，南方升元中短期利率债债券型证券投资基金基金合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 4 月 1 日－2020 年 6 月 15 日）	
	南方理财 14 天债券 A	南方升元中短期利率债债券 C
1.本期已实现收益	1,332,171.23	7,714,526.30
2.本期利润	1,332,171.23	7,714,526.30
3.期末基金资产净值	273,472,386.59	15,151,888.44

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，所以，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。

3.3 基金净值表现（转型后）

3.3.1 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

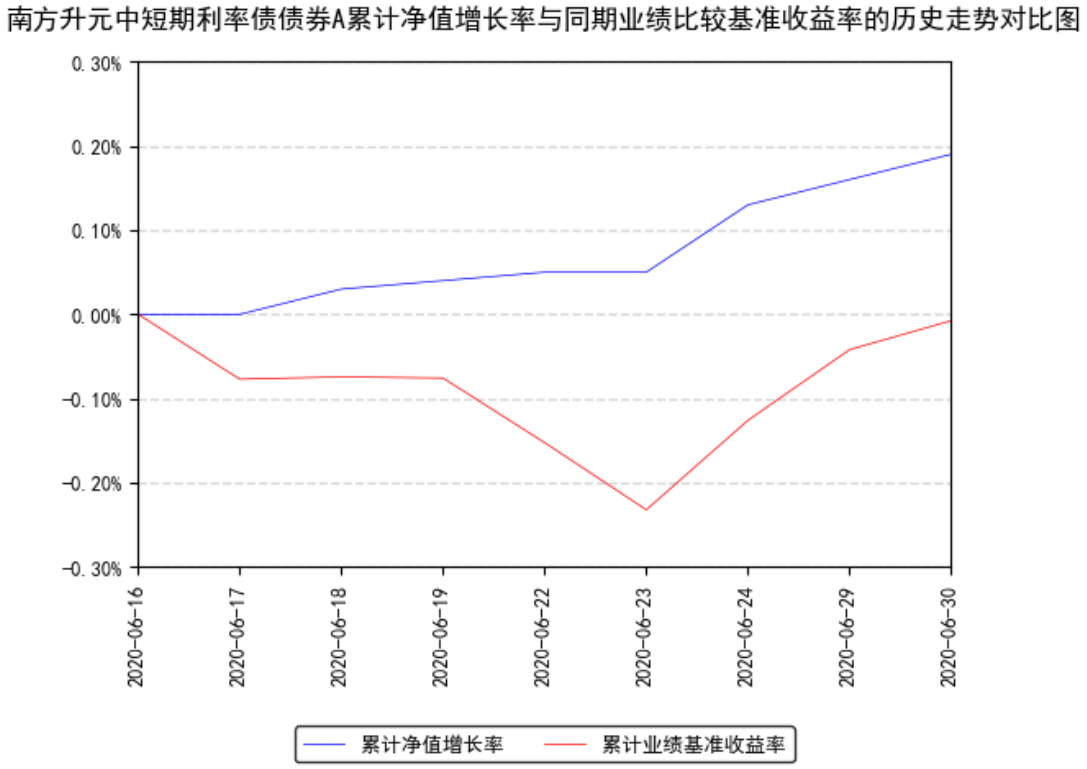
南方升元中短期利率债债券 A

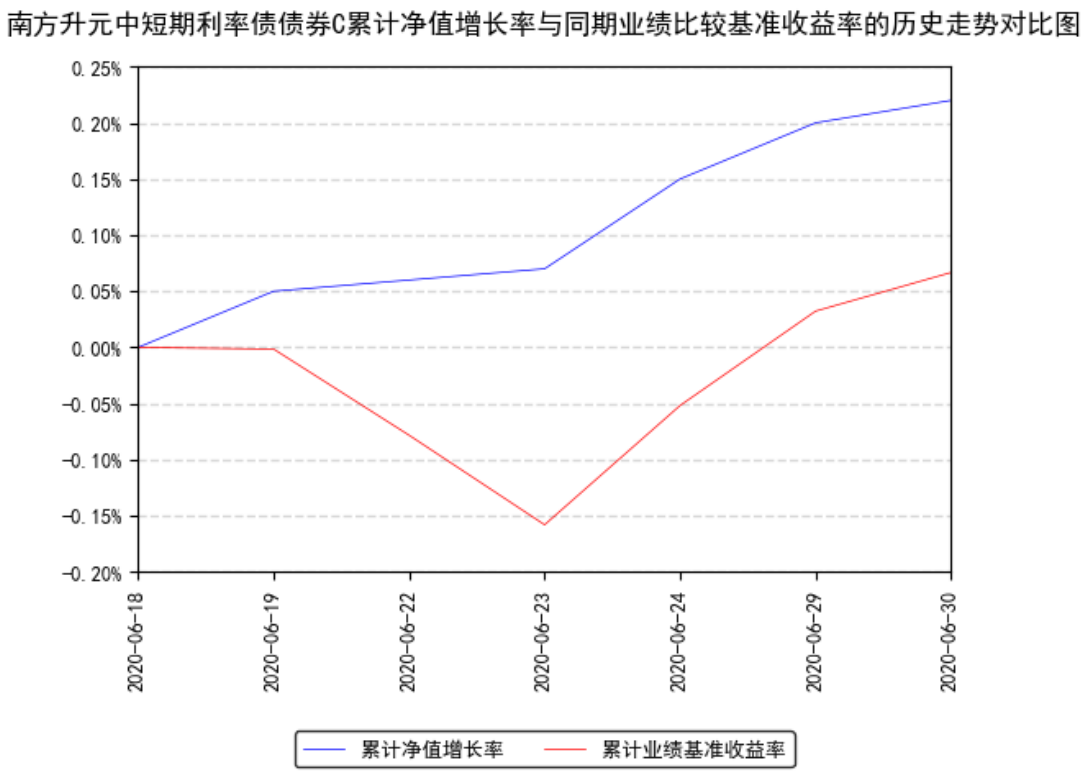
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.19%	0.03%	-0.01%	0.07%	0.20%	-0.04%

南方升元中短期利率债债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效起至今	0.22%	0.03%	0.07%	0.08%	0.15%	-0.05%

3.3.2 自基金转型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：1、本基金转型日期为 2020 年 6 月 16 日,本基金合同于 2020 年 6 月 16 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末基金尚未完成建仓。

2、本基金从 2020 年 6 月 16 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2020 年 6 月 18 日起存续。

3.4 基金净值表现（转型前）

3.4.1 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

南方理财 14 天债券 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
2020.04.01-2020.06.15	0.3782%	0.0080%	0.2854%	0.0000%	0.0928%	0.0080%
2020.01.01-2020.06	1.0339%	0.0066%	0.6282%	0.0000%	0.4057%	0.0066%

.15						
2019.07.01-2020.06.15	2.3728%	0.0049%	1.3249%	0.0000%	1.0479%	0.0049%
2017.07.01-2020.06.15	10.1593%	0.0037%	4.1370%	0.0000%	6.0223%	0.0037%
2015.07.01-2020.06.15	17.6349%	0.0042%	7.0310%	0.0000%	10.6039%	0.0042%
2012.08.14-2020.06.15	33.8009%	0.0053%	11.3336%	0.0000%	22.4673%	0.0053%

南方理财 14 天债券 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
2020.04.01-2020.06.15	0.4391%	0.0080%	0.2854%	0.0000%	0.1537%	0.0080%
2020.01.01-2020.06.15	1.1680%	0.0066%	0.6282%	0.0000%	0.5398%	0.0066%
2019.07.01-2020.06.15	2.6591%	0.0049%	1.3249%	0.0000%	1.3342%	0.0049%
2017.07.01-2020.06.15	11.1095%	0.0037%	4.1370%	0.0000%	6.9725%	0.0037%
2015.07.01-2020.06	19.3392%	0.0042%	7.0310%	0.0000%	12.3082%	0.0042%

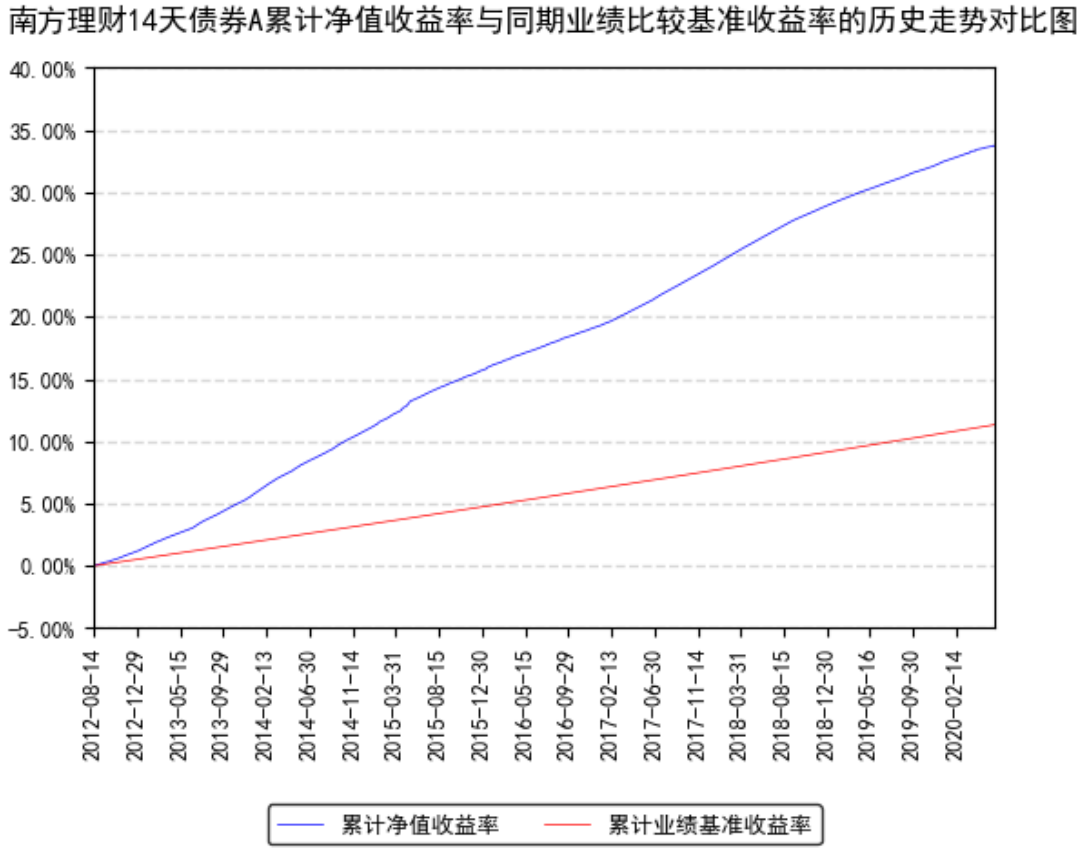
.15						
2012.08.14-2020.06.15	36.8758%	0.0053%	11.3336%	0.0000%	25.5422%	0.0053%

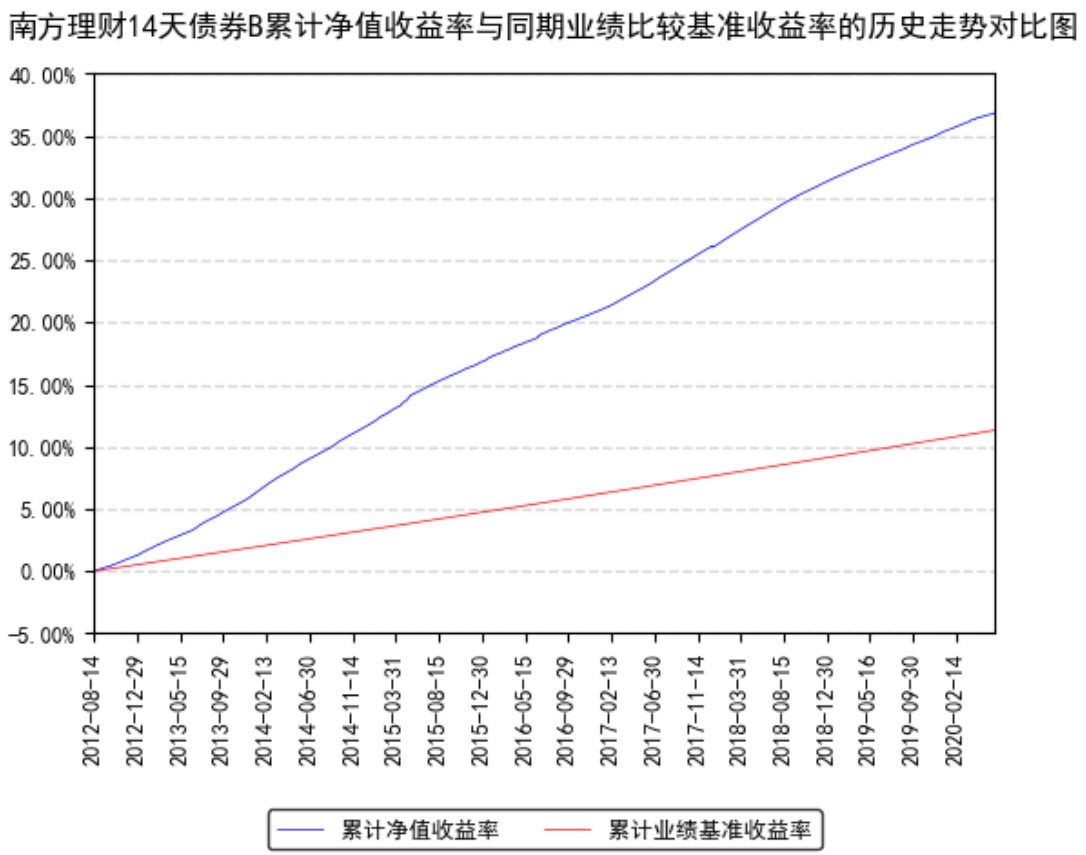
注：1、本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

2、本基金计算份额净值收益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、自 2020 年 5 月 14 日起本基金收益分配的支付方式由在运作期期末集中支付调整为按日支付。

3.4.2 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：1、本基金从 2020 年 6 月 16 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2020 年 6 月 18 日起存续。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		
金凌志	本基金基金经理	2020 年 6 月 16 日	-	12 年	中央财经大学经济学硕士，具有基金从业资格。曾先后就职于中国出口信用保险公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、长盛基金、嘉实基金，历任项目经理、信用分析师、基金经理助理、投资经理。2017 年 5 月加入南方基金；2018 年 2 月 2 日至 2018 年 12 月 6 日，任南方和利基金经理；2018 年 3 月 9 日至 2019 年 5 月 24 日，任南方乾利、南方浙利基金经理；2017 年 7 月 28 日至 2019 年 10 月 16 日，任南方荣知基金经理；2018 年 1 月 19 日至 2019 年 11 月 20 日，任

					南方卓利基金经理；2017 年 7 月 28 日至今，任南方润元、南方纯元基金经理；2019 年 3 月 26 日至今，任南方惠利基金经理；2019 年 8 月 30 日至今，任南方贺元利率债基金经理；2019 年 11 月 20 日至今，任南方卓利基金经理；2020 年 1 月 2 日至今，任南方创利基金经理；2020 年 3 月 26 日至今，任南方集利 18 个月债券基金经理；2020 年 6 月 12 日至今，任南方昭元债券基金经理；2020 年 6 月 16 日至今，任南方升元中短利率债基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

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		
夏晨曦	本基金基金经理（已离任）	2012 年 8 月 14 日	2020 年 6 月 16 日	15 年	香港科技大学理学硕士，具有基金从业资格。2005 年 5 月加入南方基金，曾担任金融工程研究员、固定收益研究员、风险控制员等职务，现任现金投资部总经理、固定收益投资决策委员会副主席。2008 年 6 月 17 日至 2012 年 7 月 20 日，任固定收益部投资经理；2013 年 1 月 22 日至 2014 年 12 月 15 日，任南方理财 30 天基金经理；2012 年 7 月 20 日至 2015 年 1 月 13 日，任南方润元基金经理；2014 年 7 月 25 日至 2016 年 11 月 17 日，任南方薪金宝基金经理；2014 年 12 月 5 日至 2016 年 11 月 17 日，任南方理财金基金经理；2012 年 10 月 19 日至 2019 年 10 月 15 日，任南方理财 60 天基金经理；2014 年 12 月 15 日至 2019 年 10 月 15 日，任南方收益宝基金经理；2016 年 2 月 3 日至 2019 年 10 月 15 日，任南方日添益货币基金经理；2017 年 8 月 9 日至 2019 年 10 月 15 日，任南方天天宝基金经理；2012 年 8 月 14 日至 2020 年 6

					月 16 日，任南方理财 14 天基金经理；2014 年 7 月 25 日至今，任南方现金增利、南方现金通基金经理；2016 年 10 月 20 日至今，任南方天天利基金经理；2018 年 11 月 8 日至今，任南方 1-3 年国开债基金经理；2018 年 12 月 5 日至今，任南方 3-5 年农发债基金经理；2019 年 3 月 15 日至今，任南方 7-10 年国开债基金经理；2020 年 3 月 5 日至今，任南方 0-5 年江苏城投债基金经理；2020 年 4 月 17 日至今，任南方 1-5 年国开债基金经理。
罗军妮	本基金基金经理（已离任）	2018 年 9 月 7 日	2020 年 6 月 16 日	8 年	女，南开大学金融学专业硕士，具有基金从业资格。曾就职于渤海证券、鹏华基金，历任研究员、债券交易员。2016 年 6 月加入南方基金；2016 年 11 月 9 日至 2018 年 9 月 7 日，任南方现金增利基金经理助理；2018 年 9 月 7 日至 2020 年 6 月 16 日，任南方理财 14 天基金经理；2020 年 6 月 12 日至今，任南方日添益货币基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.3 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、中国证监会和本基金基金合同的规定，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，本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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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，是由于接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

4.5 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年二季度经济触底回升。4-5 月工业增加值单月同比已经正增长，投资端地产和基建反弹节奏领先制造业，消费修复相对缓慢。二季度随着供需缓解，食品价格回落，带动 CPI 下行。美联储二季度无进一步降息操作，国内方面，央行二季度将超额存款准备金利率从 0.72%调整至 0.35%，资金面整体稳定。市场层面，二季度利率债收益率先下后上，曲线扁平化，信用债整体表现不及同期限国开债。

投资运作上，组合利用短久期利率债获取稳定票息，并积极参与利率债波段，同时在市场调整时控制回撤幅度。

展望未来，下半年经济将在内需发力和外需波动之中缓慢修复，修复的过程存在一定不确定性。利率债方面，当前收益率已经回到了相对合理的水平，预计整体以震荡为主。

4.6 报告期内基金的业绩表现

截至转型后报告期末，本报告期（2020 年 06 月 16 日-2020 年 06 月 30 日）本基金 A 份额净值为1.0019元，份额净值增长率为0.19%，同期业绩基准增长率为-0.01%；本基金C 份额净值为 1.0022 元，份额净值增长率为 0.22%，同期业绩基准增长率为 0.07%。

截至转型前报告期末，本报告期（2020 年 04 月 01 日-2020 年 06 月 15 日）本基金 A 份额净值收益率为 0.3782%，同期业绩基准收益率为 0.2854%；本基金 B 份额净值收益率为 0.4391%,同期业绩基准收益率为 0.2854%.

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告（转型后）

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	-	-
	其中：股票	-	-

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	229,748,000.00	70.08
	其中：债券	229,748,000.00	70.08
	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	90,000,000.00	27.45
	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	3,909,510.46	1.19
8	其他资产	4,180,911.83	1.28
9	合计	327,838,422.29	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	99,740,000.00	36.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	130,008,000.00	47.60
	其中：政策性金融债	130,008,000.00	47.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	229,748,000.00	84.12

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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	209917	20 贴现国债 17	1,000,000	99,740,000.00	36.52
2	170310	17 进出 10	500,000	50,110,000.00	18.35
3	200211	20 国开 11	500,000	49,615,000.00	18.17
4	200203	20 国开 03	200,000	20,282,000.00	7.43
5	108801	进出 1901	100,000	10,001,000.00	3.66

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 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

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名的前五名权证投资明细

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,211.07
2	应收证券清算款	1,399,867.89
3	应收股利	-
4	应收利息	2,719,006.36
5	应收申购款	59,826.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,180,911.83

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 投资组合报告（转型前）

6.1 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	160,012,493.49	54.54
	其中：债券	160,012,493.49	54.54

	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	106,400,253.20	36.27
	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	24,919,280.38	8.49
4	其他资产	2,030,735.24	0.69
5	合计	293,362,762.31	100.00

6.2 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	10.41	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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。

6.2.1 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。

6.3 基金投资组合平均剩余期限

6.3.1 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	20
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	85
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	11

6.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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 134 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

6.3.3 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	80.10	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）-60 天	20.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）-90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）-120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）-397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.94	-

6.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

6.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	99,858,534.65	34.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,153,958.84	20.84
	其中：政策性金融债	60,153,958.84	20.84
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	160,012,493.49	55.44
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

6.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	209917	20 贴现国债 17	1,000,000	99,858,534.65	34.60
2	170310	17 进出 10	500,000	50,153,958.84	17.38

3	108801	进出 1901	100,000	10,000,000.00	3.46

6.7 “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	0.2015%
报告期内偏离度的最低值	-0.0002%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1159%

6.7.1 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本基金无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

6.7.2 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本基金无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

6.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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。

6.9 投资组合报告附注

6.9.1 基金计价方法说明

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和折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

6.9.2 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

6.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,211.07
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,028,524.17
4	应收申购款	-

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,030,735.24

6.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§7 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	南方升元中短期利率债债券 A	南方升元中短期利率债债券 C
基金合同生效日(2020 年 6 月 16 日)基金份额总额	288,624,275.03	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	689,499.28	100.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	16,697,279.62	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	272,616,494.69	100.00

§8 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	南方理财 14 天债券 A	南方理财 14 天债券 B
报告期期初基金份额总额	410,457,326.09	6,096,147,296.24
报告期期间基金总申购份额	1,719,007.82	11,455,335.99
报告期期间基金总赎回份额	138,703,947.32	6,092,450,743.79
报告期期末基金份额总额	273,472,386.59	15,151,888.44

§9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

9.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

9.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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。

§10 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

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。

§11 影响投资者决策的其他重要信息（转型后）

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 影响投资者决策的其他重要信息（转型前）

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200401-20200408	1,766,227,889.99	-	1,766,227,889.99	-	-
机构	2	20200401-20200614	1,500,005,486.70	7,062,764.35	1,507,068,251.05	-	-
机构	3	20200409-20200415	1,028,749,116.46	1,603,745.66	1,030,352,862.12	-	-
机构	4	20200401-20200415	1,319,844,938.19	1,907,694.77	1,321,752,632.96	-	-

产品特有风险
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、《南方理财 14 天债券型证券投资基金基金合同》；

2、《南方理财 14 天债券型证券投资基金托管协议》；

3、《南方升元中短期利率债债券型证券投资基金基金合同》；

4、《南方升元中短期利率债债券型证券投资基金托管协议》；

5、南方升元中短期利率债债券型证券投资基金(原南方理财 14 天债券型证券投资基金）2020 年第 2 季度报告原文。

13.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

13.3 查阅方式

网站：http://www.nffund.com