

# 南方理财 60 天债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 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

送出日期：2021 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 2021 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。

南方理财 60 天债券型证券投资基金（转型前）本报告期自 2020 年 10 月 1 日起至 2020 年 12 月 15 日止，南方理财 60 天债券型证券投资基金（转型后）本报告期自 2020 年 12 月 16 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	南方理财 60 天债券
基金主代码	202305
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 16 日
报告期末基金份额总额	391,800,890.04 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 180 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。具体投资策略包括：1、利率策略；2、信用债投资策略；3、放大策略等。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
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	南方理财 60 天债券 A	南方理财 60 天债券 B	南方理财 60 天债券 E
下属分级基金的交易代码	202305	202306	001041
报告期末下属分级基金的份额总额	169,333,259.41 份	222,467,630.63 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 60 天”。

## 2.2 基金基本情况（转型前）

基金简称	南方理财 60 天债券		
基金主代码	202305		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 10 月 19 日		
报告期末基金份额总额	393,547,032.83 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 180 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。具体投资策略包括：1、利率策略；2、信用债投资策略；3、放大策略等。		
业绩比较基准	七天通知存款税后利率		
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	南方理财 60 天债券 A	南方理财 60 天债券 B	南方理财 60 天债券 E
下属分级基金的交易代码	202305	202306	001041
报告期末下属分级基金的份额总额	171,079,402.20 份	222,467,630.63 份	0.00 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 60 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 12 月 16 日—2020 年 12 月 31 日）		
	南方理财 60 天债券 A	南方理财 60 天债券 B	南方理财 60 天债券 E
1. 本期已实现收益	164,844.60	243,675.82	-
2. 本期利润	261,075.74	369,553.69	-
3. 加权平均基金份额 本期利润	0.0015	0.0017	-
4. 期末基金资产净值	169,593,100.65	222,837,184.32	-
5. 期末基金份额净值	1.0015	1.0017	-

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、本基金于 2020 年 12 月 16 日转型。本次转型主要涉及估值方法的变更，自 2020 年 12 月 16 日起，本基金的估值方法不再采用“摊余成本法”，调整为采用“市值法”计量基金资产净值。转型后的南方理财 60 天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 10 月 1 日—2020 年 12 月 15 日）		
	南方理财 60 天债券 A	南方理财 60 天债券 B	南方理财 60 天债券 E
1. 本期已实现收益	709,401.70	987,256.93	41.74
2. 本期利润	709,401.70	987,256.93	41.74
3. 期末基金资产净值	171,079,402.20	222,467,630.63	0.00

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

南方理财 60 天债券 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	0.15%	0.01%	0.06%	0.00%	0.09%	0.01%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

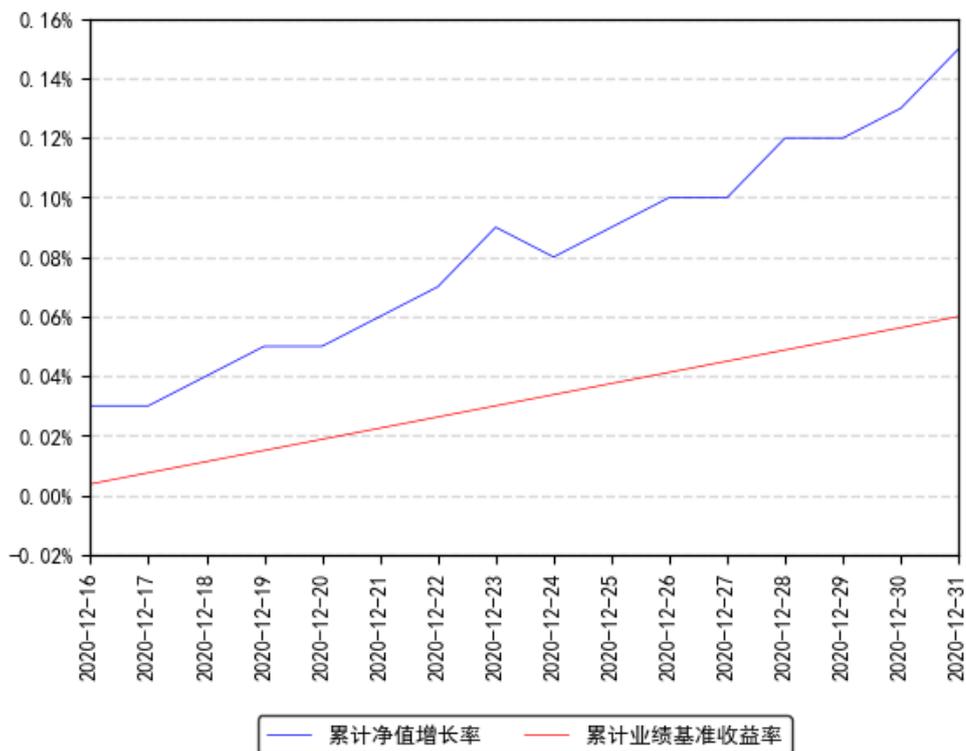
## 南方理财 60 天债券 B

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	0.17%	0.01%	0.06%	0.00%	0.11%	0.01%

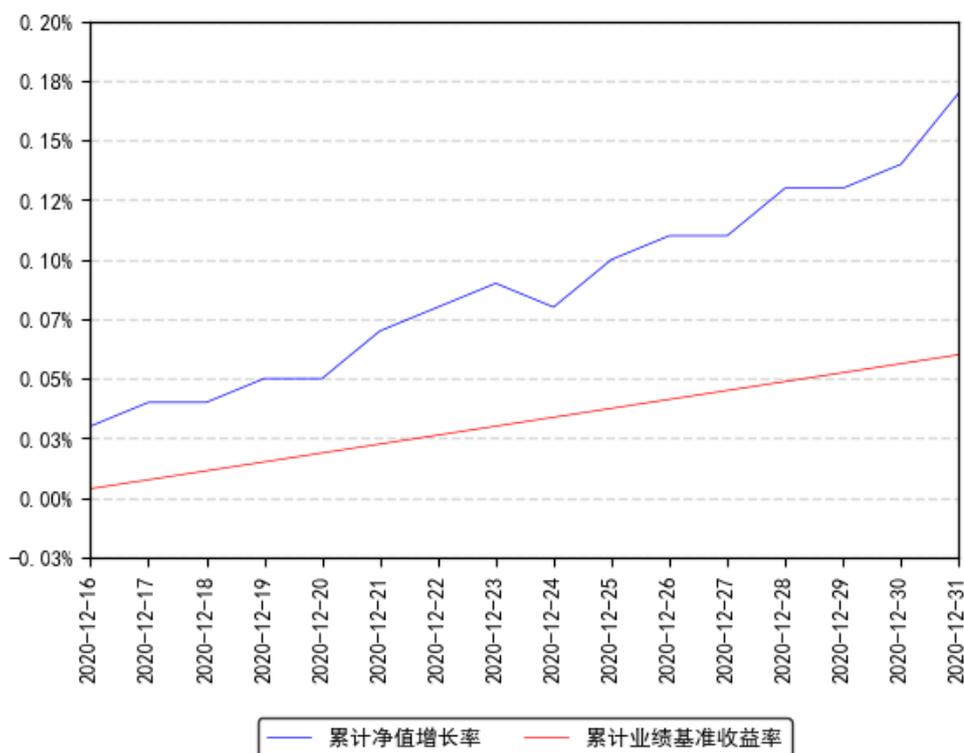
注：本基金转型后 E 级份额未有投资者持有。

### 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

南方理财60天债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方理财60天债券B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金转型日期为2020年12月16日，本基金合同于2020年12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。

### 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 60 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
过去三个月	0.3915%	0.0010%	0.2854%	0.0000%	0.1061%	0.0010%
过去六个月	0.7761%	0.0023%	0.6320%	0.0000%	0.1441%	0.0023%
过去一年	1.7770%	0.0060%	1.3211%	0.0000%	0.4559%	0.0060%
过去三年	8.8599%	0.0058%	4.1331%	0.0000%	4.7268%	0.0058%

过去五年	16.6044%	0.0056%	7.0270%	0.0000%	9.5774%	0.0056%
自基金合 同生效起 至今	34.6765%	0.0078%	11.8231%	0.0000%	22.8534%	0.0078%

南方理财 60 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
过去三个 月	0.4528%	0.0010%	0.2854%	0.0000%	0.1674%	0.0010%
过去六个 月	0.9110%	0.0023%	0.6320%	0.0000%	0.2790%	0.0023%
过去一年	2.0600%	0.0060%	1.3211%	0.0000%	0.7389%	0.0060%
过去三年	9.7951%	0.0058%	4.1331%	0.0000%	5.6620%	0.0058%
过去五年	18.2852%	0.0056%	7.0270%	0.0000%	11.2582%	0.0056%
自基金合 同生效起 至今	37.8872%	0.0078%	11.8231%	0.0000%	26.0641%	0.0078%

南方理财 60 天债券 E

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
过去三个 月	0.2913%	0.0026%	0.2854%	0.0000%	0.0059%	0.0026%
过去六个 月	0.6864%	0.0028%	0.6320%	0.0000%	0.0544%	0.0028%
过去一年	1.7118%	0.0061%	1.3211%	0.0000%	0.3907%	0.0061%
过去三年	8.8982%	0.0059%	4.1331%	0.0000%	4.7651%	0.0059%
过去五年	16.7594%	0.0057%	7.0270%	0.0000%	9.7324%	0.0057%
自基金合 同生效起	20.7470%	0.0070%	8.2297%	0.0000%	12.5173%	0.0070%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

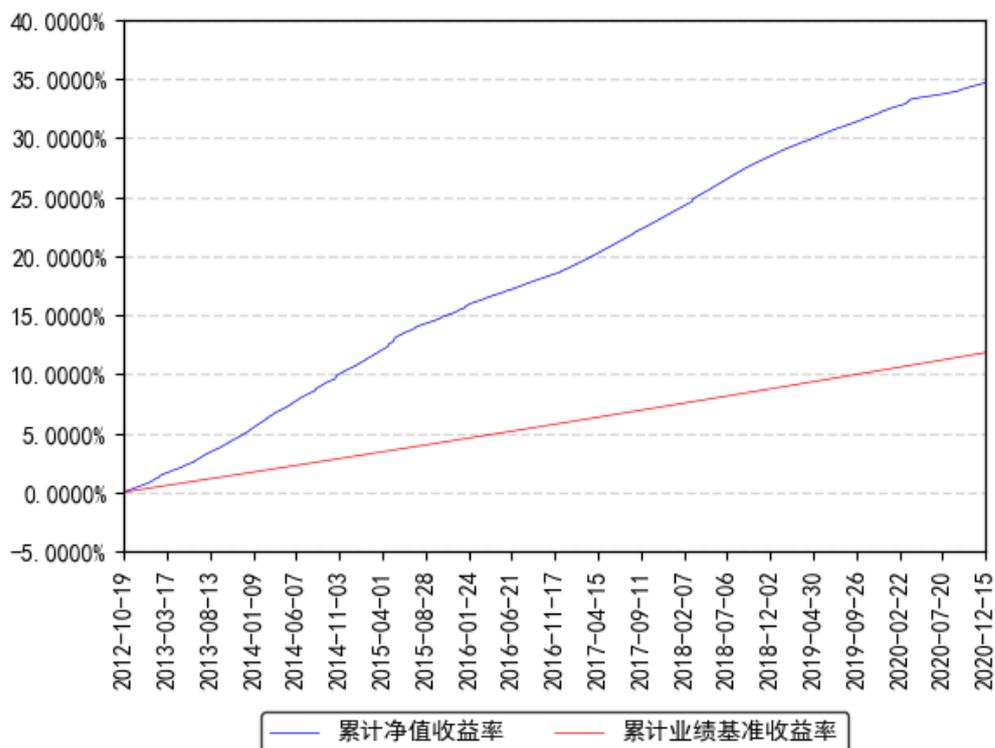
注:1、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期末集中支付。

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/新增类别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。

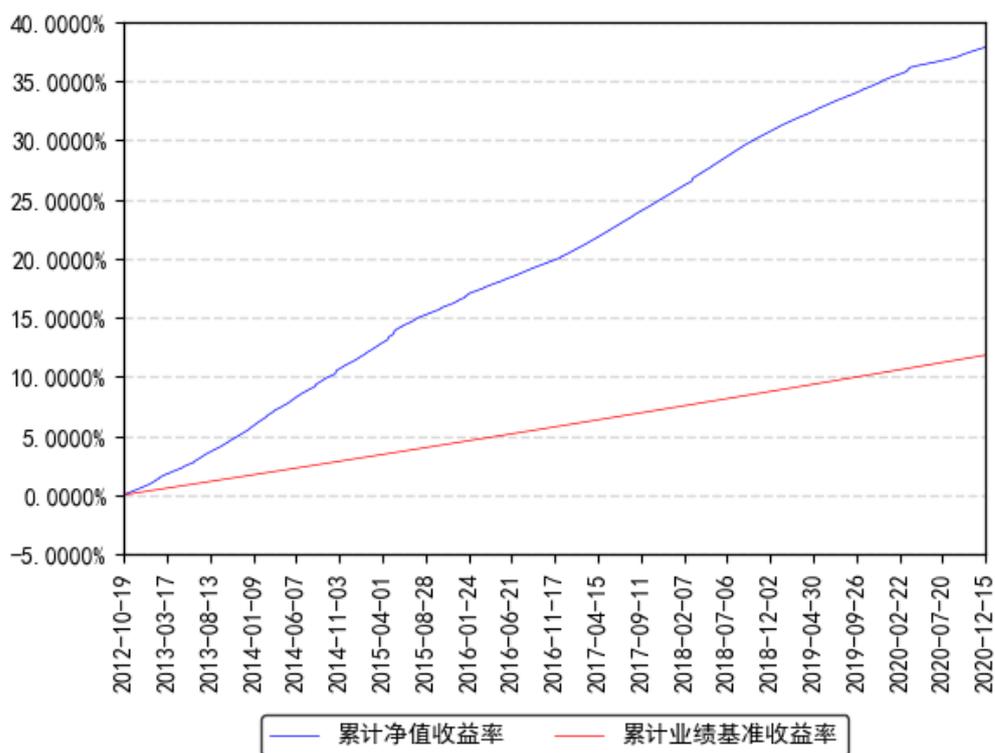
3、本基金 E 类份额于 2020 年 12 月 10 日赎空,相关收益数据按实际持有期间计算。

### 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

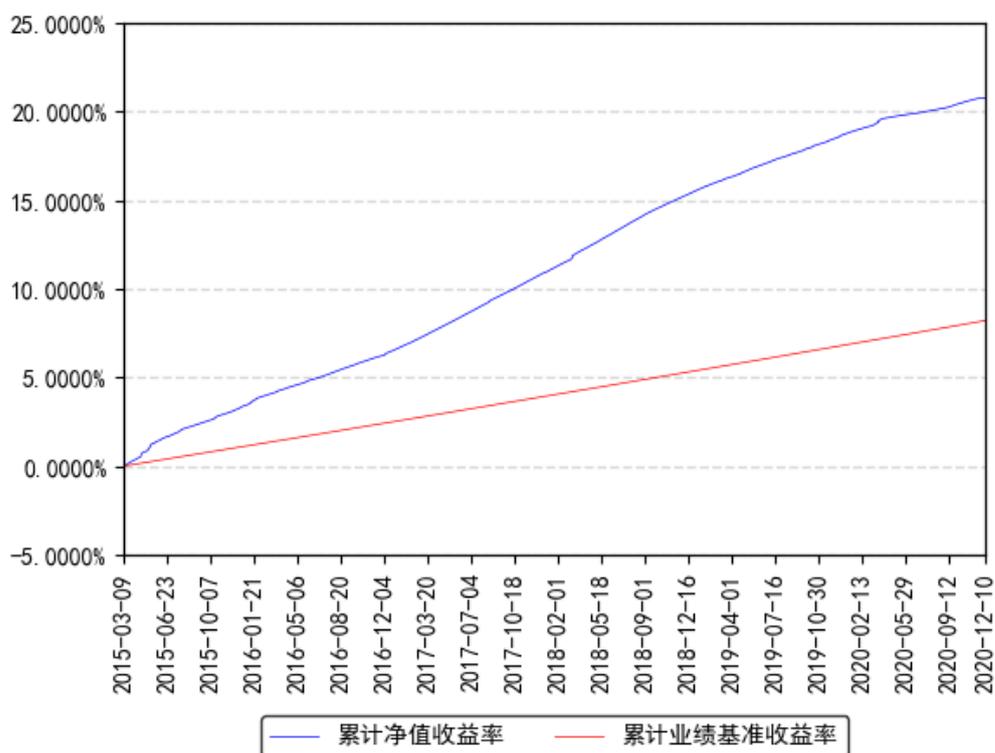
南方理财60天债券A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方理财60天债券B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方理财60天债券E累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：原南方理财 60 天债券型证券投资基金本报告期自 2020 年 10 月 1 日起至 2020 年 12 月 15 日止，E 类份额于 2020 年 12 月 10 日赎空，相关数据和指标按该期限计算。

## § 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		
王啸	本基金基金经理	2020年12月16日	-	7年	香港大学金融学硕士，具有基金从业资格。2013年8月加入南方基金，历任信用分析师、转债研究员、新股研究员。2016年3月18日至2016年12月9日，任南方通利、南方丰元、南方双元的基金经理助理。2016年12月9日至2018年2月2日，任南方荣光、南方荣毅、南方荣冠基金经理；2016年12月28日至2018年12月7日，任南方荣发基金经理；2019年5月24日至2020年6月16日，任南方高元基金经理；2016年12月9日至今，任南方荣欢基金经理；2016年12月28日至今，任南方荣安基金经理；2019年10月23日至今，任南方荣发基金经理；2019年12月20日至今，任南方远利基金经理；2020年2月14日至今，任南方鑫利基金经理；2020年12月15日至今，任南方理财60天基金经理。

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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 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		
董浩	本基金基金经理（已	2016年11月17日	2020年12月16日	10年	南开大学金融学硕士，具有基金从业资格。2010年7月加入南方基金，历任交易管理部债券交易员、固定收益部货币

	离任)			<p>理财类研究员;2014年3月31日至2015年9月11日,任南方现金通基金经理助理;2015年9月11日至2016年8月17日,任南方50债基金经理;2015年9月11日至2018年7月4日,任南方中票基金经理;2017年8月9日至2019年10月15日,任南方天天宝基金经理;2018年12月5日至2020年5月22日,任南方3-5年农发债基金经理;2019年3月15日至2020年5月22日,任南方7-10年国开债基金经理;2016年11月17日至2020年12月15日,任南方理财60天基金经理;2015年9月11日至今,任南方现金通基金经理;2016年2月3日至今,任南方日添益货币基金经理;2016年8月17日至今,任南方10年国债基金经理;2018年11月8日至今,任南方1-3年国开债基金经理;2019年5月24日至今,任南方收益宝基金经理;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。</p>
--	-----	--	--	--

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。

#### 4.2.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 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，未出现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% 的情况。

### 4.5 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度经济继续修复。1-11 月工业增加值同比增长 2.3%，较三季度继续修复；固定资产投资累计同比增长 2.6%，社会消费品零售总额累计同比下滑 4.8%，消费跌幅收窄。1-11 月 CPI 平均增长 2.7%，受到猪周期下行的拖累，CPI 趋于回落；PPI 平均下滑 2.0%，原油、黑色等工业品价格的回暖带动 PPI 筑底回升。11 月末 M2 同比增长 10.7%，四季度信贷和社融增量较三季度回落，社融增速基本见顶。

美联储四季度维持利率不变，维持 QE 购买量不变。欧央行四季度维持三大利率不变，并进一步增加了紧急购债计划规模。国内央行四季度未进行降准降息。四季度美元指数下跌 4.14%，人民币对美元汇率中间价升值 2852 个基点。全季度来看，银行间隔夜、7 天回购加权利率均值为 1.70%、2.50%，分别较上季度下行 17BP 和上行 17BP。

市场层面，四季度货币市场收益率下行，曲线陡峭化。其中，1 年国债、1 年国开收益率分别下行 17BP、28BP，3 个月 AAA 等级同业存单下行 12BP，6 个月 AAA 等级同业存单下行 26BP，1 年 AAA 等级同业存单下行 17BP。本基金已顺利完成了转型。

展望 2021 年一季度，经济层面，四季度 PMI 仍维持在扩张区间。通胀方面，预计一季度 CPI 回落到 -0.5% 左右，PPI 底部回升至 0.5% 左右。政策方面，央行年末投放力度显著加大，目前来看，在信用风险和降低实体融资成本的影响下，央行货币政策有所放松，但长期来看，货币政策应当还是会跟随基本面情况进行调整。我们认为，一季度货币政策基调仍以宽松为主，货币市场利率中枢或进一步下行。

### 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 12 月 16 日-2020 年 12 月 31 日）本基金 A 份额净值为 1.0015 元，份额净值增长率为 0.15%，同期业绩基准增长率为 0.06%；本基金 B 份额净值为 1.0017 元，份额净值增长率为 0.17%，同期业绩基准增长率为 0.06%；本基金持有人未实际持有本基金 E 类份额。

截至转型前报告期末，本报告期（2020 年 10 月 01 日-2020 年 12 月 15 日）本基金 A 份额净值收益率为 0.3915%，同期业绩基准收益率为 0.2854%；本基金 B 份额净值收益率为 0.4528%，同期业绩基准收益率为 0.2854%；本基金 E 份额净值收益率为 0.2913%，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	482,575,900.00	89.20
	其中：债券	482,575,900.00	89.20
	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	50,000,195.00	9.24
	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	1,215,888.43	0.22
8	其他资产	7,212,173.03	1.33
9	合计	541,004,156.46	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	44,941,500.00	11.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,082,000.00	25.50
	其中：政策性金融债	79,999,000.00	20.39
4	企业债券	28,496,400.00	7.26
5	企业短期融资券	240,174,000.00	61.20
6	中期票据	20,197,000.00	5.15
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	48,685,000.00	12.41
9	其他	-	-
10	合计	482,575,900.00	122.97

## 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	200201	20 国开 01	500,000	50,005,000.00	12.74
2	112015063	20 民生银行 CD063	500,000	48,685,000.00	12.41
3	019640	20 国债 10	450,000	44,941,500.00	11.45
4	012001812	20 中航资本 SCP003	200,000	20,032,000.00	5.10
5	160206	16 国开 06	200,000	20,018,000.00	5.10

## 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

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除 16 国开 06（证券代码 160206）、20 国开 01（证券代码 200201）、20 民生银行 CD063（证券代码 112015063）外其他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。

1、16 国开 06（证券代码 160206）、20 国开 01（证券代码 200201）

根据中国银保监会公告，2020 年 12 月 25 日，因国家开发银行存在“为违规的政府购买服务项目提供融资”等 24 项违规情形，中国银保监会决定对其处罚款 4880 万元。

2、20 民生银行 CD063（证券代码 112015063）

2020 年 7 月 14 日，中国民生银行股份有限公司因“违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资”等 30 项违规行为，被中国银保监会处没收违法所得 296.47 万元，罚款 10486.47 万元，罚没合计 10782.94 万元的行政处罚。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

**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	2,458.25
2	应收证券清算款	110,584.30
3	应收股利	-

4	应收利息	7,015,969.48
5	应收申购款	83,161.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,212,173.03

#### 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	219,510,888.90	55.68
	其中：债券	219,510,888.90	55.68
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	150,100,545.16	38.07
	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	21,791,213.96	5.53
4	其他资产	2,865,132.83	0.73
5	合计	394,267,780.85	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	0.53	
	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	53
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	78
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

#### 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 180 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	48.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）-60 天	17.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）-90 天	17.71	-
	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）	15.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.43	-

#### 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	49,837,371.62	12.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,948,138.94	25.39
	其中：政策性金融债	99,948,138.94	25.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,000,002.80	5.08
6	中期票据	-	-
7	同业存单	49,725,375.54	12.63
8	其他	-	-
9	合计	219,510,888.90	55.76
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	200201	20 国开 01	700,000	69,982,907.63	17.78
2	019640	20 国债 10	500,000	49,837,371.62	12.66
3	112015063	20 民生银行 CD063	500,000	49,725,375.54	12.63
4	160206	16 国开 06	200,000	20,005,458.73	5.08
5	012001040	20 陆金开 SCP001	200,000	20,000,002.80	5.08
6	200406	20 农发 06	100,000	9,959,772.58	2.53

#### 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	0.0213%
报告期内偏离度的最低值	-0.0132%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0094%

##### 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除 16 国开 06（证券代码 160206）、20 国开 01（证券代码 200201）、20 民生银行 CD063（证券代码 112015063）外其他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。

#### 1、16 国开 06（证券代码 160206）、20 国开 01（证券代码 200201）

根据中国银保监会公告，2020 年 12 月 25 日，因国家开发银行存在“为违规的政府购买服务项目提供融资”等 24 项违规情形，中国银保监会决定对其处罚款 4880 万元。

#### 2、20 民生银行 CD063（证券代码 112015063）

2020 年 7 月 14 日，中国民生银行股份有限公司因“违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资”等 30 项违规行为，被中国银保监会处没收违法所得 296.47 万元，罚款 10486.47 万元，罚没合计 10782.94 万元的行政处罚。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 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	2,458.25
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,862,674.58
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,865,132.83

#### 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	南方理财 60 天债券 A	南方理财 60 天债券 B	南方理财 60 天债券 E
基金合同生效日 (2020 年 12 月 16 日) 基金份额总额	171,079,402.20	222,467,630.63	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	985,885.68	-	-
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	2,732,028.47	-	-
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	169,333,259.41	222,467,630.63	-

### § 8 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	南方理财 60 天债券 A	南方理财 60 天债券 B	南方理财 60 天债券 E
报告期期初基金份额 总额	194,542,595.11	220,851,312.11	22,213.85
报告期期间基金总申 购份额	929,606.03	1,616,318.52	0.03
报告期期间基金总赎 回份额	24,392,798.94	-	22,213.88
报告期期末基金份额 总额	171,079,402.20	222,467,630.63	-

### § 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

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	20201216-20201231	216,661,976.63	11,077.40	-	216,673,054.03	55.30%
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。							

### 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		间					
机构	1	20201001- 20201215	215,095,793.86	1,566,182.77	-	216,661,976.63	55.04%

**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 60 天债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方理财 60 天债券型证券投资基金托管协议》；
- 3、《南方理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》；
- 4、《南方理财 60 天债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、南方理财 60 天债券型证券投资基金 2020 年 4 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>