

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
送出日期:2013年8月27日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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、完整性、及时性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的约定，于2013年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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运用基金资产，但不保证基金一定盈利，基金过往业绩并不代表未来表现。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及其更新。

本半年度报告摘要自半年度报告正文、投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告财务数据未经审计。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方金利定期开放债券
基金主代码	160128
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金成立日	2012年5月17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
报告期末基金份额总额	1,637,611,527.02份
基金合同存续期	不定期
基金上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年7月16日
下属分级基金的基金简称	南方金利定期开放债券A 南方金利定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	160128 160129
报告期末下属分级基金的份额总额	971,196,080.69份 666,415,446.33份

注:本基金在交易行情系统净值揭示等其他信息披露场合下,可简称为“南方金利”。

2.2 基金产品说明

投资目标 在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的前提下,力求获得高于业绩比较基准的稳定收益。

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、宏观政策方向及资金面曲线分析,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策略上,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 三年定期存款利率后收益上涨

风险收益特征 本基金为债券基金,其长期平均风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	鲍文革	赵军
信息披露负责人	0755-82763888	010-66105799
联系电话	040-889-8999	95588
电子邮箱	manager@southfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	0755-82763889	010-66105798
传真	0755-82763889	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 http://www.southfund.com

基金年度报告备置地点 基金托管人的办公地址

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

基金级别	南方金利定期开放债券A	南方金利定期开放债券C
报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	46,441,777.41	30,985,783.44
本期利润	54,397,992.09	36,525,824.14
加权平均基金份额本期利润	0.0564	0.0548
本期基金份额净值增长率	5.50%	5.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0447	0.0422
期末基金资产净值	1,028,645,656.64	704,118,569.02
期末基金份额净值	1.059	1.057

注:1.本期实现收益指基金本期利润收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和减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.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(期末利润,不包括本期利润)。

3.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不计费用的净值。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率与其同期业绩基准收益率的比较

南方金利定期开放债券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
过去一个月	0.00%	0.09%	0.35%	0.02%	-0.35%	0.07%
过去三个月	2.00%	0.10%	1.07%	0.01%	0.93%	0.09%
过去六个月	5.50%	0.09%	2.13%	0.02%	3.37%	0.07%
过去一年	8.11%	0.08%	4.34%	0.01%	3.77%	0.07%
自基金合同生效至至今	9.08%	0.07%	4.95%	0.01%	4.13%	0.06%

南方金利定期开放债券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
过去一个月	0.00%	0.09%	0.35%	0.02%	-0.35%	0.07%
过去三个月	2.00%	0.10%	1.07%	0.01%	0.93%	0.09%
过去六个月	5.50%	0.09%	2.13%	0.02%	3.37%	0.07%
过去一年	8.11%	0.08%	4.34%	0.01%	3.77%	0.07%
自基金合同生效至至今	9.08%	0.07%	4.95%	0.01%	4.13%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩基准收益率的比较

南方金利定期开放债券A

南方金利定期开放债券C

注:根据相关法律法规和基金合同,本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内。建仓期结束时,本基金各项资产配置比例符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4号文批准,由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广州信托投资公司共同发起设立。2000年,经中国证监会证监基字[2000]78号文批准进行了增资扩股,注册资本达到1亿元人民币。2005年,经中国证监会证监基字[2005]201号文批准进行增资扩股,注册资本达1亿元人民币。2010年,经证监许可[2010]1073号文核准在深圳证券交易所上市,华泰证券持有公司45%,深圳市投资控股有限公司30%,厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。公司在北京、上海、深圳等地设有分公司,在香港设有子公司—南方东英资产管理有限公司。

截至报告期末,公司管理资产规模超过2,000亿元,旗下管理42只开放式基金,1只封闭式基金,多个全国社保、企业年金和客户理财产品组合。

4.1.2 基金经理经验(基金经理基金组合)

基金经理

姓名 职务 任期基金的任本基金基金经理,任职日期和离任日期

姓名 职务 任期基金的任本基金基金经理,任职日期和离任日期