

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:2016年3月30日

§ 1 提示及目录

1.1 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、及时性承担责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期间2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

南方聚利

基金类别	南方聚利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)
基金简称	南方聚利
场内简称	南方聚利
基金代码	160331
易基金份额	人民币
基金合同生效日	2015年1月6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
基金运作方式	开放式基金
基金类型	债券型
基金费率	赎回费：0.5%
最近七日年化收益率	3.653%
基金资产净值	274,480,100.00
基金总资产	274,480,100.00
基金总负债	-
基金净资产	274,480,100.00
基金份额净值	1.0000
基金份额上市交易简称	南方聚利
基金份额上市交易场所	深圳证券交易所
下一会计报告期的起始日期	2016年1月1日
下一会计报告期的截止日期	2016年3月31日
下一会计报告期的披露日期	2016年3月31日
基金份额净值的公告日期	2016年3月31日
基金份额净值的披露日期	2016年3月31日
基金份额净值的披露时间	40:49:00(北京时间)

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“南方聚利”。

2.2 基金产品说明

南方聚利

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前提下,力求获得超越比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金将从宏观经济指标、利率走势、资金面、政策面、市场情绪等方面综合分析,实施积极的资产配置策略,并结合对不同券种的估值分析,选择具有较好配置价值的券种进行投资。
业绩比较基准	一年期定期存款利率(税后)+1.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,风险低于股票型基金,风险高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

南方聚利

名称	基金管理人	南方基金管理有限公司
住所	中国北京市西城区金融街33号16层	
法定代表人	史文强	
注册资本	1000万元人民币	
基金业协会职务	南基投顾	
办公地址	中国北京市西城区金融街33号16层	
电话	010-66000400	
传真	010-66000400	
网站	www.njfd.com	
电子邮箱	mailto:njfd@njfd.com	
客户服务电话	400-020-8889	
注册地址	深圳市福田区中心商务区滨河大道5018号京基金融大厦32层	
办公地址	北京市西城区金融街33号16层	
邮政编码	100033	
联系人	王海峰	
基金业协会职务	南基投顾	
电话	010-66000400	
传真	010-66000400	
网站	www.njfd.com	
电子邮箱	mailto:njfd@njfd.com	
客户服务电话	400-020-8889	
注册地址	北京市西城区金融街33号16层	
办公地址	北京市西城区金融街33号16层	
邮政编码	100033	
联系人	王海峰	
基金业协会职务	南基投顾	
电话	010-66000400	
传真	010-66000400	
网站	www.njfd.com	
电子邮箱	mailto:njfd@njfd.com	

2.4 信息披露方式

南方聚利

基金类别	南方聚利
基金简称	南方聚利
场内简称	南方聚利
基金代码	160331
易基金份额	人民币

2.5 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

南方聚利

金额单位:人民币元	2015年	2014年	2013年1月1日至2013年12月31日
报告期初基金资产净值	1,204,531.70	1,027,130.23	304,370.00
报告期利息收入	40,321,440.62	1,793,719.47	26,822,037.42
减: 报告期手续费	2,020,416.42	2,020,416.42	2,020,416.42
报告期利息支出	40,477,375.42	25,362,260.07	25,362,260.07
报告期红利再投金额	0.00	0.00	0.00
报告期申购金额	1,013,000.00	1,013,000.00	1,013,000.00
报告期赎回金额	122,511.23	122,511.23	122,511.23
报告期转换金额	0.00	0.00	0.00
报告期定期定额投资金额	13,779.00	13,779.00	13,779.00
报告期转换金额	0.00	0.00	0.00
报告期转换净额	13,779.00	13,779.00	13,779.00
报告期期末基金资产净值	284,020.12	284,020.12	284,020.12
报告期期末可供分配基金份额总额	284,020.12	284,020.12	284,020.12
报告期期末可供分配金额	0.00	0.00	0.00
报告期末基金资产净值和份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
报告期期末可供分配基金份额总额与期末基金资产净值的差额	0.00	0.00	0.00

注:1.本期已实现收益指基金本期收入,收入包括利息收入、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.期初可供分配利润,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。(期末未分配利润,不是当期盈余)。

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所列数字。

4.本基金自2014年12月1日起增加C类收费模式,原有收费模式称A类。

3.2 基金净值表现

南方聚利

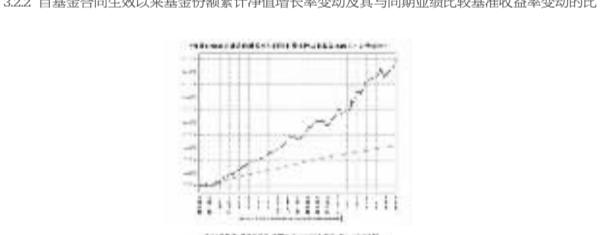
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方聚利A

阶段	份额净值增长(%)	份额净值增长标准差(%)	同期业绩比较基准收益率(%)	同期业绩比较基准收益率标准差(%)
过去三个月	2.05%	0.13%	0.95%	0.01%
过去六个月	0.8%	0.17%	1.2%	0.01%
过去一年	12.2%	0.15%	10.2%	0.08%
过去三年	12.2%	0.15%	12.2%	0.15%
过去五年	12.2%	0.15%	12.2%	0.15%
过去十年	12.2%	0.15%	12.2%	0.15%
成立以来	12.2%	0.15%	12.2%	0.15%

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

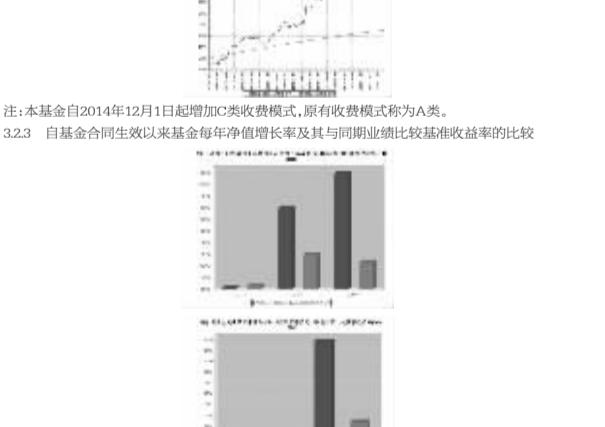
南方聚利



注:本基金自2014年12月1日起增加C类收费模式,原有收费模式称A类。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方聚利



注:同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

南方聚利

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红金额	现金形式分配金额	再投资形式分配金额	年度利润分配合计	备注
2015年	1,000.00	1,000.00	0.00	2,211,711.40	20,342,200.67
2014年	0.7000	0.7000	0.00	424,607.71	0.00
2013年	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2012年	1,000.00	1,000.00	0.00	2,000,000.00	0.00
合计	1,700.00	1,700.00	0.00	54,071,014.00	40,342,200.67

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

南方聚利

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作为国内首批规范的基金管理公司正式成立,成为“基金新时代”的起始点。

南方基金管理有限公司(30%)、厦门国信信托有限公司(15%)、兴业证券股份有限公司(10%)。目前,公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地都有分公司,在长春和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中,南方东英是境内基金管理公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末,南方基金管理有限公司(不含子公司)管理资产规模超过5,000亿元,旗下管理85只基金,多个全国社保、企业年金及专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理助理)及基金经理助理简介

南方聚利

姓名 职务 (任本基金基金经理的日期) (任本基金基金经理助理的日期)

陈红宇 基金经理 (2013年1月6日)