南方金利定期开放债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:2019年3月27日

§1 重要提示及目录

1.1 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。

本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2019年3月25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,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§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	
场内简称	南方金利	
基金主代码	160128	
交易代码	160128	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年5月17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	
报告期末基金份额总额	276,318,922.16份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	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	224,151,456.07份	52,167,466.09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“南方金利”。

2.2 基金产品说明

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基础上, 力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
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、宏观政策方向及收益率曲线分析, 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基础上,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	三年期定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、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		南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southern-fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
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.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

1、南方金利定期开放债券A

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	13,351,277.66	8,250,263.02	11,609,012.90
本期利润	23,292,131.37	2,360,924.53	3,944,746.48
加权平均基金份额本期利润	0.1030	0.0098	0.0166
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.0530	-0.0037	0.0035
期末基金资产净值	236,028,784.95	241,462,646.11	241,750,872.66
期末基金份额净值	1.053	0.996	1.003
3.1.3 累计期末指标	2018年末	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	53.32%	38.54%	37.20%

2、南方金利定期开放债券C

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	3,585,387.67	3,614,751.17	5,227,104.83
本期利润	7,165,773.53	779,219.88	1,544,033.28
加权平均基金份额本期利润	0.0943	0.0067	0.0135
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.0504	-0.0062	0.0001
期末基金资产净值	54,798,268.09	116,256,865.51	116,246,719.31
期末基金份额净值	1.050	0.994	1.000
3.1.3 累计期末指标	2018年末	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	50.23%	36.25%	35.33%

注:

1.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损益。

2.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。

3.2 基金净值表现

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

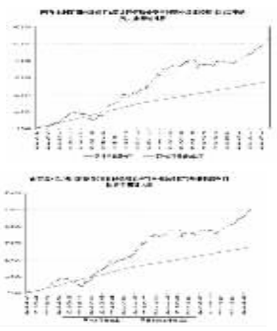
南方金利定期开放债券A

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
过去三个月	3.22%	0.06%	0.70%	0.01%	2.52%	0.05%
过去六个月	6.17%	0.07%	1.40%	0.01%	4.77%	0.06%
过去一年	10.66%	0.07%	2.82%	0.01%	7.84%	0.06%
过去三年	13.40%	0.09%	8.97%	0.01%	4.43%	0.08%
过去五年	46.60%	0.11%	18.09%	0.01%	28.51%	0.10%
自基金合同生效起至今	53.32%	0.11%	27.69%	0.01%	25.63%	0.10%

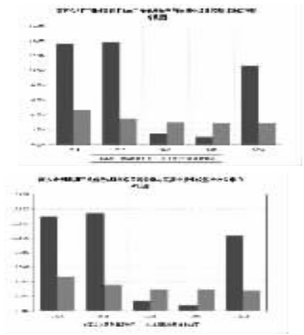
南方金利定期开放债券C

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
过去三个月	3.03%	0.07%	0.70%	0.01%	2.33%	0.06%
过去六个月	5.98%	0.08%	1.40%	0.01%	4.58%	0.07%
过去一年	10.26%	0.07%	2.82%	0.01%	7.44%	0.06%
过去三年	12.44%	0.09%	8.97%	0.01%	3.47%	0.08%
过去五年	44.06%	0.11%	18.09%	0.01%	25.97%	0.10%
自基金合同生效起至今	50.23%	0.11%	27.69%	0.01%	22.54%	0.10%

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较



3.2.3 过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

南方金利定期开放债券A

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018年	0.4700	7,749,833.08	2,953,101.78	10,702,934.86	-
2017年	0.1700	2,649,151.08	1,452,507.75	4,101,658.83	-
2016年	1.0600	16,499,850.01	8,435,911.41	24,935,761.42	-
合计	1.7000	26,898,834.17	12,841,520.94	39,740,355.11	-

南方金利定期开放债券C

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018年	0.4400	1,371,492.52	1,547,091.28	2,918,583.80	-
2017年	0.1300	769,073.68	744,426.77	1,513,500.45	-
2016年	1.0400	6,141,976.18	5,614,089.35	11,756,065.53	-
合计	1.6100	8,282,542.38	7,905,607.40	16,188,149.78	-

§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

1998年3月6日,经中国证监会批准,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,成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018年1月,公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司,注册资本金3亿元人民币。目前股权结构:华泰证券股份有限公司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%。目前,公司在北京、上海、合肥、成都、深圳、南京等地设有分公司,在香港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,南方基金管理股份有限公司(不含子公司)管理资产规模近8,300亿元,旗下管理178只开放式基金,多个全国社保、基本养老保险、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李曦	本基金基金经理	2012年5月17日	-	11年	女,清华大学金融学学士、硕士,注册金融分析师(CFA),具有基金从业资格。2007年加入南方基金,担任信用债高级分析师、现任固定收益投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员。2010年9月至2012年6月,任南方宝元基金经理;2012年12月至2014年9月,任南方安心基金经理;2015年12月至2017年2月,任南方润元基金经理;2013年7月至2017年9月,任南方稳利基金经理;2016年10月至2017年12月,任南方通利、南方荣冠基金经理;2016年8月至2018年2月, 任南方丰元基金经理;2016年11月至2018年2月,任南方荣安基金经理;2017年1月至2018年7月, 任南方和利基金经理;2017年3月至2018年7月,任南方荣优基金经理;2017年5月至2018年7月, 任南方荣尊基金经理;2017年6月至2018年7月,任南方荣知基金经理;2017年7月至2018年7月, 任南方荣年基金经理;2010年9月至今, 任南方多利基金经理;2012年5月至今, 任南方金利基金经理;2016年9月至今, 任南方多元基金经理;2016年12月至今, 任南方睿见混合基金经理;2017年1月至今,任南方宏元基金经理; 2017年9月至今,任南方兴利基金经理;2018年7月至今,任南方配售基金经理。
刘骥	本基金基金经理助理	2016年11月28日	-	6年	香港大学经济学专业硕士,具有基金从业资格。2012年10月加入南方基金固定收益部,历任信用研究分析师、信用研究分析小组组长。2016年11月至今,任南方多利、南方金利的基金经理助理。
张宗磊	本基金基金经理助理	2018年5月17日	-	4年	北京大学金融学专业硕士,具有基金从业资格。2014年7月加入南方基金,任固定收益研究部衍生品研究员、信用分析师。2018年5月至今, 任南方金利基金经理助理。

注:1、对基金的首任基金经理,其“任职日期”按基金合同生效日填写,“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期,对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期,为便于投资者理解。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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,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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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《南方金利定期开放债券型证券投资基金基金合同》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,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。

4.3.2 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。 公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内,两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在,并且交易占优比也没有明显异常,未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 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7次, 是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及投资组合的投资策略需要所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年经济逐步下行,较2017年有显著回落,全年GDP增速从2017年的6.9%回落至6.6%。通胀方面,CPI在猪肉价格上涨叠加低基数的影响下,全年中枢小幅回升至2.1%,PPI在高基数和油价下跌的影响下,全年中枢回落至3.5%。金融数据方面,18年12月末M2增速降至8.1%,虽然信贷规模较17年有显著增长,但由于非标融资大幅减少,社融增速整体大幅下滑。

美联储2018年加息4次,不过美国经济开始呈现出衰退的迹象,美联储下调了对2019年的经济增长和通胀预测。欧洲经济同样出现放缓,欧央行下调了2019年对欧洲经济增长和通胀的预期。国内方面,央行的政策态度较2017年有较大转变,从偏紧的货币政策转向了中性偏松, 并在年内大部分时间维持了合理充裕的流动性环境。2018年美元指数上涨4.14%,人民币对美元汇率中间价贬值3290个基点。

市场层面,2018年利率债收益率大幅下行,且短端下行幅度大于长端,收益率曲线呈现显著陡峭化。其中,1年国债、1年国开收益率分别下行119BP、193BP,10年国债、10年国开收益率分别下行65BP、118BP。信用债内部表现有所分化,城投表现略好于同期限金融债,中票表现弱于同期限金融债,民企信用风险成为信用债投资关注的焦点。

投资运作上,南方金利的投资以信用债为主,主要选择信用风险相对可控、收益相对较好的信用债进行投资。组合在年初配置了较高的杠杆,考虑到基金将于5月份开放申购赎回,为保持开放期合理流动性,一季度以降杠杆为主,在市场收益率下行过程中逐步减仓。6月份组合规模稳定后,组合提升了杠杆,加大配置力度,增加了中期信用债的仓位,同时也以少量仓位参与了利率债的波段操作,并通过精选个券为组合贡献了一定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A份额净值为1.053元,报告期内,份额净值增长率为10.66%,同期业绩基准增长率为2.82%;本基金C份额净值为1.050元,报告期内,份额净值增长率为10.26%,同期业绩基准增长率为2.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年国内经济存在进一步下行的空间,海外央行货币政策趋紧对国内的掣肘也在逐步缓解。利率债方面,收益率中长期下行的时间和空间都还存在,2019年利率债收益率整体或将继续下行,但下行的幅度已经较为有限。利率债的绝对收益率水平已经显著低于历史均值,且随着稳增长政策的持续发力,宽信用的效果或开始逐步显现,这将制约利率债收益率的大幅下行。信用债方面,2018年信用债收益率下行的节奏较利率债偏慢,信用利差依然存在一定的收窄空间,但2019年信用风险上仍然面临很大的不确定性,在获取信用债的持有收益、博取信用利差下行机会的过程中仍需重视信用风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定, 本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度,明确基金估值的程序和技术;建立了估值委员会,组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统,估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术,导致基金资产净值的变化在0.25%以上的,对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次;基金合同生效满6个月后,若基金在每季度最后一个交易日收盘后每10份基金份额可分配利润金额高于0.1元(含),则基金须在15个工作日之内进行收益分配, 每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的50%;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式,具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值; 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,而C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况, 本报告期内第一季度末满足分红条件,本基金于2018年4月18日进行了收益分配(A类每10份基金份额派发红利0.12元,C类每10份基金份额派发红利0.1元); 本报告期内第二季度末满足分红条件,本基金于2018年7月16日进行了收益分配(A类每10份基金份额派发红利0.13元,C类每10份基金份额派发红利0.13元);本报告期内第三季度末满足分红条件,本基金于2018年10月19日进行了收益分配 (A类每10份基金份额派发红利0.22元,C类每10份基金份额派发红利0.21元);本报告期内第四季度末满足分红条件,本基金于2019年1月18日进行本基金的2018年第四季度收益分配 (A类每10份基金份额派发红利0.27元,C类每10份基金份额派发红利0.26元)。

4.8 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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 本基金托管人在对南方金利定期开放债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内, 南方金利定期开放债券型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方金利定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内, 南方金利定期开放债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了3次利润分配,分配金额为13,621,518.78元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方金利定期开放债券型证券投资基金2018年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本基金2018年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2019)第23201号“标准无保留意见的审计报告”。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:南方金利定期开放债券型证券投资基金
报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末2018年12月31日	上年度末2017年12月31日
资产:		
银行存款	512,915.01	11,409,343.66
结算备付金	10,951,528.39	14,425,449.08
存出保证金	29,164.11	41,795.64
交易性金融资产	522,307,825.61	596,291,444.04
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	520,308,825.61	596,291,444.04
资产支持证券投资	1,999,000.00	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	5,986,653.13	-
应收利息	7,904,254.23	15,633,213.74
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	547,692,340.48	637,801,246.16
负债和所有者权益	本期末2018年12月31日	上年度末2017年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	249,997,474.00	268,249,367.34
应付证券清算款	6,099,520.32	10,996,846.91
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	147,878.56	182,027.56
应付托管费	44,363.56	54,608.29
应付销售服务费	13,933.28	29,581.62
应付交易费用	-3,216.05	94.60
应交税费	66,378.03	-
应付利息	144,955.74	215,208.22
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	354,000.00	354,000.00
负债合计	256,865,287.44	280,081,734.54
所有者权益:		
实收基金	276,318,922.16	359,332,674.76
未分配利润	14,508,130.88	-1,613,163.14
所有者权益合计	290,827,053.04	357,719,511.62
负债和所有者权益总计	547,692,340.48	637,801,246.16

注:报告截止日2018年12月31日,南方金利定期开放债券A份额净值1.053元,基金份额总额224,151,456.07份; 南方金利定期开放债券C份额净值1.050元,基金份额总额52,167,466.09份;总份额合计276,318,922.16份。

7.2 利润表

会计主体:南方金利定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	37,269,821.27	14,776,613.52
1.利息收入	23,517,071.98	29,757,502.67
其中:存款利息收入	176,051.70	208,018.44
债券利息收入	22,853,006.27	29,549,484.23
资产支持证券利息收入	215,601.24	-
买入返售金融资产收入	272,412.77	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	231,119.80	-6,256,019.37
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	123,594.32	-6,256,019.37
资产支持证券投资收益	107,525.48	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	13,521,239.57	-8,724,869.78
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	389.92	-
减:二、费用	6,811,916.37	11,636,469.11
1.管理人报酬	1,864,989.36	2,160,291.21
2.托管费	559,496.80	648,087.42
3.销售服务费	234,861.63	350,712.73
4.交易费用	17,277.23	15,874.52
5.利息支出	3,584,307.60	7,992,401.51
其中:卖出回购金融资产支出	3,584,307.60	7,992,401.51
6.税金及附加	81,288.08	-
7.其他费用	469,695.67	469,101.72
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	30,457,904.90	3,140,144.41
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	30,457,904.90	3,140,144.41

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方金利定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期末2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	359,332,674.76	-1,613,163.14	357,719,511.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,457,904.90	30,457,904.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-83,013,752.60	-715,092.22	-83,728,844.82
其中:1.基金申购款	90,993,696.59	1,937,874.08	92,931,570.67
2.基金赎回款	-174,007,449.19	-2,652,966.30	-176,660,415.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-13,621,518.66	-13,621,518.66
五、期末所有者权益(基金净值)	276,318,922.16	14,508,130.88	290,827,053.04
项目	上年度可比期间2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	357,157,178.62	840,413.35	357,997,591.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,140,144.41	3,140,144.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	2,175,496.14	21,438.38	2,196,934.52
其中:1.基金申购款	2,175,496.14	21,438.38	2,196,934.52
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-5,615,159.28	-5,615,159.28
五、期末所有者权益(基金净值)	359,332,674.76	-1,613,163.14	357,719,511.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____杨小松_____ _____徐超_____ _____徐超_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》,公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”,公司股权结构等事项未发生变化, 并已于2018年1月4日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	-2,892.89	100.00%	-17,402.14	83.44%
关联方名称	上年度可比期间2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	-496.66	100.00%	-14,509.25	80.77%

注:1.上述佣金按市场佣金率计算。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,864,989.36	2,160,291.21
其中:支付销售机构的客户维护费	632,159.82	603,343.58

注:支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.60%/当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	559,496.80	648,087.42

注:

支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.18%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.18%/当年天数。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2018年1月1日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方金利定期开放债券A	南方金利定期开放债券C	合计
中国工商银行	-	233,614.84	233,614.84
南方基金	-	1,230.85	1,230.85
合计	-	234,845.69	234,845.69
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方金利定期开放债券A	南方金利定期开放债券C	合计
中国工商银行	-	348,568.62	348,568.62
南方基金	-	2,117.40	2,117.40
合计	-	350,686.02	350,686.02

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给南方基金,再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。C类基金份额约定的销售服务费年费率为0.30%。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为:

日销售服务费=前一日C类基金资产净值 X 约定年费率/当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期2