

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7月16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责任个别及连带责任。

本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7月12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。

本报告告期内财务资料未经审计。

本报告告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 南方金利定期开放债券

场内简称 南方金利

基金代码 160128

交易代码 160128

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2012年1月1日

报告期末基金份额总额 280,999,669,238份

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，力求获得高于同期银行基准的收益回报。

投资策略 本基金在中长期利率趋势分析的基础上，结合经济增长、宏观政策变化、资金面情况等对债券市场进行综合分析，通过久期调整和券种选择来获取较高的债券组合投资收益。

业绩比较基准 三年期定期存款利率+0.5%。

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。

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

下属分级基金的名称 南方金利定期开放债券A 南方金利定期开放债券C

下属分级基金的场内简称 南方金利

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 227,291,661,598份 63,707,907,646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”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)

南方金利定期开放债券A 南方金利定期开放债券C

1.本期已实现收益 2,067,400.75 663,332.23

2.本期利润 2,387,440.42 622,496.11

3.加权平均基金份额本期利润 0.0106 0.0098

4.期末基金份额净值 237,409.4773 56,959.5747

5.期末基金份额净值 1.045 1.042

注: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将低于零星收益。

2.本期已实现收益扣除非基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和损失相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)

南方金利定期开放债券A 南方金利定期开放债券C

1.本期已实现收益 2,067,400.75 663,332.23

2.本期利润 2,387,440.42 622,496.11

3.加权平均基金份额本期利润 0.0106 0.0098

4.期末基金份额净值 237,409.4773 56,959.5747

5.期末基金份额净值 1.045 1.042

注: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将低于零星收益。

2.本期已实现收益扣除非基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和损失相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)

南方金利定期开放债券A 南方金利定期开放债券C

1.本期已实现收益 166,333.46 2,658.79

2.本期利润 269,056.63 4,472.35

3.加权平均基金份额本期利润 0.0002 0.0022

4.期末基金份额净值 80,856,020.74 2,024,219.36

5.期末基金份额净值 1.010 0.994

注: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将低于零星收益。

2.本期已实现收益扣除非基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和损失相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)

南方永利定期开放债券(LOF) C

1.本期已实现收益 186,333.46 2,658.79

2.本期利润 269,056.63 4,472.35

3.加权平均基金份额本期利润 0.0002 0.0022

4.期末基金份额净值 80,856,020.74 2,024,219.36

5.期末基金份额净值 1.010 0.994

注: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将低于零星收益。

2.本期已实现收益扣除非基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和损失相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.4 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)

南方永利定期开放债券(LOF) C

1.本期已实现收益 166,333.46 2,658.79

2.本期利润 269,056.63 4,472.35

3.加权平均基金份额本期利润 0.0002 0.0022

4.期末基金份额净值 80,856,020.74 2,024,219.36

5.期末基金份额净值 1.010 0.994

注: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将低于零星收益。

2.本期已实现收益扣除非基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和损失相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.5 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)

南方聚利定期开放债券(LOF) A

1.本期已实现收益 166,333.46 2,658.79

2.本期利润 269,056.63 4,472.35

3.加权平均基金份额本期利润 0.0002 0.0022

4.期末基金份额净值 80,856,020.74 2,024,219.36

5.期末基金份额净值 1.010 0.994

注: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将低于零星收益。

2.本期已实现收益扣除非基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和损失相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.6 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)

南方聚利定期开放债券(LOF) C

1.本期已实现收益 166,333.46 2,658.79

2.本期利润 269,056.63 4,472.35

3.加权平均基金份额本期利润 0.0002 0.0022

4.期末基金份额净值 80,856,020.74 2,024,219.36

5.期末基金份额净值 1.010 0.994

注: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将低于零星收益。

2.本期已实现收益扣除非基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和损失相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.7 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)

南方聚利定期开放债券(LOF) C

1.本期已实现收益 166,333.46 2,658.79

2.本期利润 269,056.63 4,472.35

3.加权平均基金份额本期利润 0.0002 0.0022

4.期末基金份额净值 80,856,020.74 2,024,219.36

5.期末基金份额净值 1.010 0.994

注: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将低于零星收益。

2.本期已实现收益扣除非基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和损失相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.8 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)

南方聚利定期开放债券(LOF) C

1.本期已实现收益 166,333.46 2,658.79

2.本期利润 269,056.63 4,472.35

3.加权平均基金份额本期利润 0.0002 0.0022

4.期末基金份额净值 80,856,020.74 2,024,219.36

5.期末基金份额净值 1.010 0.994

注: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将低于零星收益。

2.本期已实现收益扣除非基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和损失相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.9 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)

南方聚利定期开放债券(LOF) C

1.本期已实现收益 166,333.46 2,658.79

2.本期利润 269,056.63 4,472.35

3.加权平均基金份额本期利润 0.0002 0.0022

4.期末基金份额净值 80,856,020.74 2,024,219.36

5.期末基金份额净值 1.010 0.994

注: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将低于零星收益。

2.本期已实现收益扣除非基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和损失相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.10 主要财务指标