

## 南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金

## [2015] 第四季度报告

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2016年1月21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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	南方稳利1年定期开放债券
交易代码	000006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月23日
报告期末基金份额总额	1,656,994,491.11份

本基金在严格控制风险和追求资金长期稳定的基础上，力求获得高于行业平均水平的回报。

本基金以长期利率走势为分析基础，结合经济周期、宏观政策方向及收

益率曲线分析，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

一年定期存款利率×140%。

风险收益特征

本基金为债券基金，其预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

南方基金管理有限公司

基金托管人

中国农业银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称

南方稳利1年定期开放债券A

南方稳利1年定期开放债券C

下属分级基金的交易代码

000006 000720

报告期末下属分级基金的份额总额

1,654,632,161.98份 62,362,297.15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“南方稳

利”。

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
南方稳利1年定期开放债券	南方稳利1年定期开放债券C
1. 本期已实现收益	42,166,196.95元 1,656,991.46元
2. 本期利润	62,150,446.89元 2,349,402.32元
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0209元 0.00576元
4. 期末基金资产净值	1,654,444,721.77元 64,400,012.03元
5. 期末可供分配基金份额利润	1.038元 1.034元

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收益；

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用，采用“份额赎回

费用”平准化原则进行分摊。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

南方稳利1年定期开放债券C

阶段 净值增长率 业绩比较基准 收益率差额 标准差③ ①-③ ②-④

过去三个月 3.01% 0.14% 0.53% 0.01% 3.40% 0.13%

南方稳利1年定期开放债券C

阶段 净值增长率 业绩比较基准 收益率差额 标准差③ ①-③ ②-④

过去三个月 3.07% 0.14% 0.53% 0.01% 3.40% 0.13%

注：本基金自2014年7月24日起增加C类收费模式，原有收费模式称为A类。

## § 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
李巍	本基金基金经理	2013年7月23日 -	8年	女，清华大学金融学硕士，硕士，注册金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2000年加入南方基金管理有限公司，担任基金经理助理，现任固定收益部总监助理。2010年1月至今，担任南方稳利基金经理；2012年12月至2014年6月，担任南方现金管理部产品经理；2014年6月至今，担任南方稳利基金经理；2015年1月至今，担任南方稳利基金经理。2015年12月至今，担任南方稳利基金经理。

5.1.0.3 报告期内未持有的处于摊销期的可转换债券明细

注：本基金本报告期未持有可转换债券。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.1.1 资产配置

5.1.1.1 报告期末按行业分类的资产配置情况

5.1.1.2 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.1.1.3 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.1.1.4 报告期末按行业分类的其他资产

5.1.1.5 其他资产

5.1.1.6 合计

5.1.2 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债券投资明细

5.1.2.1 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

5.1.2.2 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权证投资明细

5.1.2.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.2.4 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.2.5 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期无投资国债期货。

5.1.2.6 报告期投资组合变动情况

5.1.2.7 报告期内基金的融资融券情况

5.1.2.8 报告期内基金的衍生品投资情况

5.1.2.9 报告期内基金的关联交易情况

5.1.2.10 报告期内基金的其他重要信息

5.2 基金产品概况

5.2.1 本期已实现收益

5.2.2 本期利润

5.2.3 期末基金资产净值

注：本基金已实现收益系指基金利息收入、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，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益扣除相关费用后，即为本期已实现收益。

5.2.4 基金净值表现

5.2.4.1 本期平均净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方现金增利货币A

阶段 净值收益率 业绩比较基准 收益率差额 标准差③ ①-③ ②-④

过去三个月 0.7270% 0.0021% 0.3460% 0.0000% 0.3814% 0.0021%

南方现金增利货币B

阶段 净值收益率 业绩比较基准 收益率差额 标准差③ ①-③ ②-④

过去三个月 0.7800% 0.0021% 0.3460% 0.0000% 0.4424% 0.0021%

注：本基金收益分配为按月结转份额。

注：本基金合同生效以来以基金累计净值冲抵净收益的，可简称为“南方现金”。

5.3 主要财务指标

5.3.1 主要财务指标

5.3.1.1 主要财务指标

5.3.1.2 报告期主要财务指标

5.3.1.3 报告期主要财务指标

5.3.1.4 报告期主要财务指标

5.3.1.5 报告期主要财务指标

5.3.1.6 报告期主要财务指标

5.3.1.7 报告期主要财务指标

5.3.1.8 报告期主要财务指标

5.3.1.9 报告期主要财务指标

5.3.1.10 报告期主要财务指标

5.3.1.11 报告期主要财务指标

5.3.1.12 报告期主要财务指标

5.3.1.13 报告期主要财务指标

5.3.1.14 报告期主要财务指标

5.3.1.15 报告期主要财务指标

5.3.1.16 报告期主要财务指标

5.3.1.17 报告期主要财务指标

5.3.1.18 报告期主要财务指标

5.3.1.19 报告期主要财务指标

5.3.1.20 报告期主要财务指标

5.3.1.21 报告期主要财务指标

5.3.1.22 报告期主要财务指标

5.3.1.23 报告期主要财务指标

5.3.1.24 报告期主要财务指标

5.3.1.25 报告期主要财务指标

5.3.1.26 报告期主要财务指标

5.3.1.27 报告期主要财务指标

5.3.1.28 报告期主要财务指标

5.3.1.29 报告期主要财务指标

5.3.1.30 报告期主要财务指标

5.3.1.31 报告期主要财务指标

5.3.1.32 报告期主要财务指标

5.3.1.33 报告期主要财务指标

5.3.1.34 报告期主要财务指标

5.3.1.35 报告期主要财务指标

5.3.1.36 报告期主要财务指标

5.3.1.37 报告期主要财务指标

5.3.1.38 报告期主要财务指标

5.3.1.39 报告期主要财务指标

5.3.1.40 报告期主要财务指标

5.3.1.41 报告期主要财务指标

5.3.1.42 报告期主要财务指标

5.3.1.43 报告期主要财务指标

5.3.1.44 报告期主要财务指标

5.3.1.45 报告期主要财务指标

5.3.1.46 报告期主要财务指标

5.3.1.47 报告期主要财务指标

5.3.1.48 报告期主要财务指标

5.3.1.49 报告期主要财务指标

5.3.1.50 报告期主要财务指标

5.3.1.51 报告期主要财务指标

5.3.1.52 报告期主要