

## 南方金利定期开放债券型证券投资基金

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:2017年3月30日

## § 1 重要提示

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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告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2017年3月27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的业绩表现。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2016年01月01日起至2016年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

基金代码 000120

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

基金合同生效日 2012年6月3日

报告期末基金资产净值 36,691,826.95元

报告期末基金份额净值 1.0000元

报告期净值增长率 240.01%、166.07%

报告期净值增长率标准差 136.23%、03.96%

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“南方金利”。

## 2.2 基金产品说明

投资目标 本基金严格控制风险和追求基金资产长期稳定增长的基础上，力求获得高于业绩比较基准的稳定收益。

投资策略 本基金在综合分析宏观经济形势、货币政策、资金供求状况、信用利差、利率期限结构、信用品种的信用风险、流动性等因素的基础上，通过久期配置、类属配置、券种选择、个券选择、杠杆运用等操作，力求在控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准 二年定期存款利率(税后)+0.5%

风险特征 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 南方基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人 姚洋 010-66100299

电子邮箱 managerfund@sfam.com.cn

客户服务电话 400-008-0999

传真 010-66293880

2.4 信息披露方式

载基金半年报正文的管理人互联网网址 http://www.zifund.com

基金年度报告备置地 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

金额单位:人民币元

3.1.1 基金管理费

项目 2016年 2015年 2014年

南方金利定期开放债券型证券投资基金 0.0200% 0.0220% 0.0440%

本期利息收入 5,227,104.03 105,36 307,205 0.5233

本期利息收入 3,944 1,044,032.26 69,464 34,960 127,666 0.4721

本期利息收入 0.0166 0.0136 0.0146 0.0108 0.1240

3.1.2 基金管理费

项目 2016年末 2015年末 2014年末

南方金利定期开放债券型证券投资基金 1.48% 1.20% 13.82% 13.41% 13.36% 12.07%

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已实现价值变动收益。

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(为期末余额,不是当期发生数)。

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,计费方式不同收益水平将低于所列数字。

## 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 份额增长(%) 份额增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.00% 0.18% 0.74% 0.01% -200% 0.17%

过去六个月 0.05% 0.18% 1.48% 0.01% -143% 0.13%

过去一年 1.49% 0.15% 3.00% 0.01% -152% 0.11%

过去二年 3.00% 0.13% 11.02% 0.01% 1030% 0.12%

自基金合同生效以来 37.20% 0.12% 20.09% 0.01% 1651% 0.11%

南方金利定期开放债券C

阶段 份额增长(%) 份额增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.00% 0.18% 0.74% 0.01% -200% 0.17%

过去六个月 0.24% 0.18% 1.48% 0.01% -124% 0.13%

过去一年 1.49% 0.15% 3.00% 0.01% -152% 0.11%

过去二年 3.00% 0.13% 11.02% 0.01% 1030% 0.12%

自基金合同生效以来 37.20% 0.12% 20.09% 0.01% 1651% 0.11%

注:南方金利定期开放债券A、南方金利定期开放债券C的业绩表现以每10份基金单位净值增长率为基准进行计算,不按整个自然年度进行折算。

3.2.2 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

南方金利定期开放债券A

项目 2016年1月1日至2016年12月31日

南方金利定期开放债券C

项目 2016年1月1日至2016年12月31日

南方金利定期开放债券A 1.48% 1.20% 13.82% 13.41% 13.36% 12.07%

南方金利定期开放债券C 1.48% 1.20% 13.82% 13.41% 13.36% 12.07%

注:南方金利定期开放债券A、南方金利定期开放债券C的业绩表现以每10份基金单位净值增长率为基准进行计算,不按整个自然年度进行折算。

3.2.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

南方金利定期开放债券A

年度 每10份基金单位收益形式及发放日 例收益分配金额(元) 例收益形式及发放日 例收益金额(元)

2010 10,000.00 16,499,890.01 8,436,911.41 24,306,761.42

2011 0.0000 34,797,225.12 16,382,726.03 51,460,443.00

2012 0.0000 89,369,890.38 42,781,826.32 132,147,685.70

合计 25600 89,369,890.38 42,781,826.32 132,147,685.70

注:合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。

3.2.4 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

南方金利定期开放债券C

年度 每10份基金单位收益形式及发放日 例收益分配金额(元) 例收益形式及发放日 例收益金额(元)

2010 10,000.00 16,499,890.01 8,436,911.41 24,306,761.42

2011 0.0000 34,797,225.12 16,382,726.03 51,460,443.00

2012 0.0000 89,369,890.38 42,781,826.32 132,147,685.70

注:合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。

3.2.5 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

南方金利定期开放债券A

年度 每10份基金单位收益形式及发放日 例收益分配金额(元) 例收益形式及发放日 例收益金额(元)

2010 10,000.00 16,499,890.01 8,436,911.41 24,306,761.42

2011 0.0000 34,797,225.12 16,382,726.03 51,460,443.00

2012 0.0000 89,369,890.38 42,781,826.32 132,147,685.70

注:合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。

3.2.6 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

南方金利定期开放债券C

年度 每10份基金单位收益形式及发放日 例收益分配金额(元) 例收益形式及发放日 例收益金额(元)

2010 10,000.00 16,499,890.01 8,436,911.41 24,306,761.42

2011 0.0000 34,797,225.12 16,382,726.03 51,460,443.00

2012 0.0000 89,369,890.38 42,781,826.32 132,147,685.70

注:合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。

3.2.7 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

南方金利定期开放债券A

年度 每10份基金单位收益形式及发放日 例收益分配金额(元) 例收益形式及发放日 例收益金额(元)

2010 10,000.00 16,499,890.01 8,436,911.41 24,306,761.42

2011 0.0000 34,797,225.12 16,382,726.03 51,460,443.00

2012 0.0000 89,369,890.38 42,781,826.32 132,147,685.70

注:合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。

3.2.8 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

南方金利定期开放债券C

年度 每10份基金单位收益形式及发放日 例收益分配金额(元) 例收益形式及发放日 例收益金额(元)

2010 10,000.00 16,499,890.01 8,436,911.41 24,306,761.42

2011 0.0000 34,797,225.12 16,382,726.03 51,460,443.00

2012 0.0000 89,369,890.38 42,781,826.32 132,147,685.70

注:合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。

3.2.9 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

南方金利定期开放债券A

年度 每10份基金单位收益形式及发放日 例收益分配金额(元) 例收益形式及发放日 例收益金额(元)

20