

南方聚利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)

2016年度报告摘要

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: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。本年度报告已经三分之二以上监事和董事签字确认，并由董事长签发。

基金托管人在履行了本基金合同规定的职责后，根据本基金合同规定，于2017年3月2日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利率期限分布情况、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。

本年度报告摘要源自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2016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	南方聚利1年定期开放债券(LOF)
场内简称	南方聚利
基金代码	160131
基金运作方式	上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2013年11月21日
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金管理人	南方基金管理有限公司
住所	深圳市深南大道1093号中国金融中心2栋19层
邮编	518040
基金合同生效日期	2013年11月21日
基金合同终止的日期	不定期
基金合同存续的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013年11月21日
下属基金份额的基金简称	南方聚利
下属基金份额的交易代码	南方聚利
下属基金份额的场内简称	-
下属基金份额的场内代码	160131
报告期末基金的总资产	2,106,066,710,008份
报告期末基金份额的净值总额	317,099,322,006份

注:本基金在交易场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

投资目标	本基金长期投资于固定收益类资产,长期稳健地为持有人创造稳定的回报,力求获得高于通胀水平的稳定收入。
投资策略	本基金将从长短期的资产分析为出发点,结合经济周期、宏观政策方向以及收益率曲线分析,在兼顾流动性、风险承受能力的情况下投资组合配置,以获取较高的风险组合收益。
业绩比较基准	1年期定期存款利率(税后)+1.2%
风险收益特征	本基金为债券基金,其长期平均风险和预期收益低于股票基金,混合基金,低风险,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	中国银行股份有限公司
姓名	赵帆文	王洪军
信息披露负责人	赵帆文	王洪军
电子邮箱	0755-25263098	010-66940496
客户服务电话	400-888-0800	95559
传真	0755-25263099	010-66940492

2.4 信息披露方式

本基金年度报告正刊载于基金管理人互联网网站

基金管理人和基金托管人住所

5.3 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 期间数	2016年	2015年	2014年
年初到报告期末	南方聚利A 4,119,307,660 40,301,214 642,904 17,047 26,622,027,424 46,708,030	南方聚利A 4,119,307,660 40,301,214 642,904 17,047 26,622,027,424 46,708,030	南方聚利A 4,119,307,660 40,301,214 642,904 17,047 26,622,027,424 46,708,030
本年已实现收益	4,046,700 1.06% 0.02% 0.01% -20.0% 0.12%	4,046,700 1.06% 0.02% 0.01% -20.0% 0.12%	4,046,700 1.06% 0.02% 0.01% -20.0% 0.12%
本期利润	16,415 1,230,306,434 46,077 2,029 45,436 20,163,203 83,389,000	16,415 1,230,306,434 46,077 2,029 45,436 20,163,203 83,389,000	16,415 1,230,306,434 46,077 2,029 45,436 20,163,203 83,389,000
加权平均基金份额本期利润	0.0073 0.0040 0.0130 0.1264 0.0913 0.0106	0.0073 0.0040 0.0130 0.1264 0.0913 0.0106	0.0073 0.0040 0.0130 0.1264 0.0913 0.0106
本期基金份额净值增长率为	0.94% 0.05% 13.79% 13.30% 9.98% -0.10%	0.94% 0.05% 13.79% 13.30% 9.98% -0.10%	0.94% 0.05% 13.79% 13.30% 9.98% -0.10%
3.1.2 年末	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配利润	0.0007 -0.0019 0.0203 0.0205 0.0221 0.0229	0.0007 -0.0019 0.0203 0.0205 0.0221 0.0229	0.0007 -0.0019 0.0203 0.0205 0.0221 0.0229
期末基金总份额	2,216,962,363.43 320,194,324.40 342,436,509,76 60,736,222,14 396,824,16 26,203,200,30 393,300	2,216,962,363.43 320,194,324.40 342,436,509,76 60,736,222,14 396,824,16 26,203,200,30 393,300	2,216,962,363.43 320,194,324.40 342,436,509,76 60,736,222,14 396,824,16 26,203,200,30 393,300
期末基金净值	1.010 1.007 1.049 1.046 1.028 1.028	1.010 1.007 1.049 1.046 1.028 1.028	1.010 1.007 1.049 1.046 1.028 1.028

注:本项为实现收益除基金额度利息收入、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,本期为本期公允价值变动收益。

2.5 期末可供分配利润,采用月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(为零余额,即不计当期盈余)。

3 所有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,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1月1日起增加C类收费模式,原有收费模式称A类。

5 本基金自2014年1月1日起增加C类收费模式,原有收费模式称A类。

6 本基金净值增长率为扣除费用后的净值增长率。

7 本基金的利润分配政策

本基金在报告期期内不存在经常关联交易。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参加与公司的公平交易原则向关联方进行股票、债券、衍生品等证券买卖时,遵循公开、公平、公正的原则,不存在利益输送行为,保护投资者合法权益。

8 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本报告期内,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《南方聚利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本着诚实

信用、勤勉尽责的原则管理本基金,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋取最大利

益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资操

作、投资决策、估值核算均符合基金合同的规定。

9 4.3 公平交易制度和公平交易情况

本基金在报告期期内不存在经常关联交易。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参

与的公平交易原则向关联方进行股票、债券、衍生品等证券买卖时,遵循公开、公平、公正的原

则,不存在利益输送行为,通过加强投资决策、交易执行的内部控制,完善对投资交易行为的

日常监控和事后分析评估,以及履行相关的报告和信息披露义务,切实防范投资管理业务中

的不公平交易和利益输送行为,保护投资者合法权益。

10 4.4 从业人员对基金的投资决策和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和操作分析

报告期内,经济企稳态势继续保持“U”型,GDP增速稳定在6.7%,工业增加值增速稳定

在6.2%左右,通胀方面,CPI保持温和走势,全年同比上涨2.0%,PPI全年同比下降1.4%,但在需求企

稳恢复和供给侧改革的刺激下,PPG快速上涨4.3%,一季度涨幅为3.3%。

海外市场,主要发达国家经济复苏步伐继续分化,美国经济复苏相对稳健,美联储12月议

息会议宣布加息,符合市场预期,但议息会议后美元指数冲高回落,人民币贬值幅度

态度不明朗,日元贬值,通胀回升,利率上有下行压力,但央行仍维持10年期利率0.7%的目标。

新兴市场方面,经济企稳态势继续保持“U”型,GDP增速稳定在6.7%,工业增加值增速

稳定在6.2%左右,通胀方面,CPI保持温和走势,全年同比上涨2.0%,PPI全年同比下降1.4%,但在需求企

稳恢复和供给侧改革的刺激下,PPG快速上涨4.3%,一季度涨幅为3.3%。

海外市场,主要发达国家经济复苏步伐继续分化,美国经济复苏相对稳健,美联储12月议

息会议宣布加息,符合市场预期,但议息会议后美元指数冲高回落,人民币贬值幅度

态度不明朗,日元贬值,通胀回升,利率上有下行压力,但央行仍维持10年期利率0.7%的目标。

新兴市场方面,经济企稳态势继续保持“U”型,GDP增速稳定在6.7%,工业增加值增速

稳定在6.2%左右,通胀方面,CPI保持温和走势,全年同比上涨2.0%,PPI全年同比下降1.4%,但在需求企

稳恢复和供给侧改革的刺激下,PPG快速上涨4.3%,一季度涨幅为3.3%。

4.4.2 报告期内企业的业绩表现

本基金在报告期期内的业绩表现

4.4.3 报告期内的行业表现

本基金在报告期期内的行业表现

4.4.4 报告期内的区域表现

本基金在报告期期内的区域表现

4.4.5 报告期内的债券表现

本基金在报告期期内的债券表现

4.4.6 报告期内的股票表现

本基金在报告期期内的股票表现

4.4.7 报告期内的基金表现

本基金在报告期期内的基金表现

4.4.8 报告期内的外汇表现

本基金在报告期期内的外汇表现

4.4.9 报告期内的黄金表现

本基金在报告期期内的黄金表现

4.4.10 报告期内的石油表现

本基金在报告期期内的石油表现

4.4.11 报告期内的农产品表现

本基金在报告期期内的农产品表现

4.4.12 报告期内的贵金属表现

本基金在报告期期内的贵金属表现

4.4.13 报告期内的能源表现

</