

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
报告送出日期：2017年10月25日
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：中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月24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运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金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，需仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告公告的财务数据未经审计。

本报告期为2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	南方聚利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)
场内简称	南方聚利
基金代码	160931
基金运作方式	上证契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2013年11月26日
报告期末基金份额总额	912,437,446.05份
投资目标	本基金严格地控制和追求基金资产增长的稳定性，在此基础上，力求获得高于同业平均水平的稳定收益。
投资策略	本基金在大类资产配置的基础上，结合经济周期、宏观政策变化以及微观行业景气度，精选具有投资价值的债券品种进行投资，从而获取稳定的资本增值收益。
业绩基准	1年期银行存款利率(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	中国银行股份有限公司

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“南聚利”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日
南方聚利A	南方聚利C
南方聚利E	160934
报告期末净值	0.988,992,097.05份
份额净值	23,445,347.70份
过去三个月	1.022
净值	1.023

注：本基金已实现收益收入、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基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于相关数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期末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

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	差额	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.66%	0.01%	0.01%	0.04%

注：1.本报告期实现收益收入、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基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于相关数字。

3.2.2 本报告期末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

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	差额	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.66%	0.01%	0.01%	0.04%

注：1.本报告期实现收益收入、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基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于相关数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1.1 本报告期末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

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	差额	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.66%	0.01%	0.01%	0.04%

注：1.本报告期实现收益收入、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基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于相关数字。

3.2.3.1 本报告期末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

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	差额	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.66%	0.01%	0.01%	0.04%

注：1.本报告期实现收益收入、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基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于相关数字。

3.2.3.2 本报告期末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

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	差额	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.66%	0.01%	0.01%	0.04%

注：1.本报告期实现收益收入、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基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于相关数字。

3.2.3.3 本报告期末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

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	差额	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.66%	0.01%	0.01%	0.04%

注：1.本报告期实现收益收入、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基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于相关数字。

3.2.3.4 本报告期末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

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	差额	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.66%	0.01%	0.01%	0.04%

注：1.本报告期实现收益收入、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基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于相关数字。

3.2.3.5 本报告期末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

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	差额	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.66%	0.01%	0.01%	0.04%

注：1.本报告期实现收益收入、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基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于相关数字。

3.2.3.6 本报告期末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

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	差额	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.66%	0.01%	0.01%	0.04%

注：1.本报告期实现收益收入、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基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于相关数字。

3.2.3.7 本报告期末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

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	差额	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.66%	0.01%	0.01%	0.04%

注：1.本报告期实现收益收入、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基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于相关数字。

3.2.3.8 本报告期末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

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	差额	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.66%	0.01%	0.01%	0.04%

注：1.本报告期实现收益收入、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基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于相关数字。

3.2.3.9 本报告期末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

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	差额	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.66%			