

南方金利定期开放债券型证券投资基金

2013第三季度报告

2013年9月30日

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

报告送出日期:2013年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月21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项,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未来表现。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。

本报告期利润:2013年7月1日至2013年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	南方金利定期开放债券
交易代码	160128
上市交易代码(LOF)	南方金利定期开放(LOF)
基金份额净值	2013/9/30 5.1717
份额期末基金单位总值	1,650,108,892.96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,力求获得高于银行存款利率的稳定收益。
投资策略	本基金以中长期定期开放式为运作方式,在充分分析宏观经济形势的基础上,结合经济周期、宏观政策等方面的变化,通过系统和人工等各种方式在充分考虑各种风险收益因素的基础上,综合运用多种投资技术,在严格控制风险的前提下,力争取得超越基准收益水平的投资回报。
业绩比较基准	三年定期存款利率(税后收益率)
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水平低于股票基金、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
下属分级基金的基金简称	南方金利定期开放债券 A 南方金利定期开放债券 C
下属分级基金的交易代码	160128 160129
报告期末该基金的份额总额	978,706,452.32份 671,941,940.74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,可简称为“南方金利”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年7月1日—2013年9月30日)		单位:人民币元
1.本期已实现收益	1,327,821.39	8,595,468.02	
2.本期利润	-3,981,971.79	-3,252,709.23	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0041	-0.0049	
4.期末基金资产净值	1,010,114,825.89	690,794.0133	
5.期末基金份额净值	1.032	1.029	
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)扣除必要的费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。 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,费用计算方法详见本招募说明书“风险揭示”部分。 3.基金净值表现未考虑持有人认购或交易本基金的各项费用,费用计算方法详见本招募说明书“风险揭示”部分。 4.2.1 本期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 南方金利定期开放债券 A 本期基金份额净值增长率为-0.399%;同期业绩比较基准增长率为1.08%;南方金利定期开放 C 本基金净值增长率为-0.009%;同期业绩比较基准增长率为0.08%。			

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,可简称为“南方金利”。

主要财务指标	报告期(2013年7月1日—2013年9月30日)	单位:人民币元
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	1,327,821.39	8,595,468.02
2.本期利润	-3,981,971.79	-3,252,709.23
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0041	-0.0049
4.期末基金资产净值	1,010,114,825.89	690,794.0133
5.期末基金份额净值	1.032	1.029

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)扣除必要的费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
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,费用计算方法详见本招募说明书“风险揭示”部分。
3.基金净值表现未考虑持有人认购或交易本基金的各项费用,费用计算方法详见本招募说明书“风险揭示”部分。
4.2.2 本期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
南方金利定期开放债券 A 本期基金份额净值增长率为-0.399%;同期业绩比较基准增长率为1.08%;南方金利定期开放 C 本基金净值增长率为-0.009%;同期业绩比较基准增长率为0.08%。 | | |

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,可简称为“南方金利”。

主要财务指标	报告期(2013年7月1日—2013年9月30日)	单位:人民币元
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	1,327,821.39	8,595,468.02
2.本期利润	-3,981,971.79	-3,252,709.23
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0041	-0.0049
4.期末基金资产净值	1,010,114,825.89	690,794.0133
5.期末基金份额净值	1.032	1.029

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)扣除必要的费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
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,费用计算方法详见本招募说明书“风险揭示”部分。
3.基金净值表现未考虑持有人认购或交易本基金的各项费用,费用计算方法详见本招募说明书“风险揭示”部分。
4.2.3 本期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
南方金利定期开放债券 A 本期基金份额净值增长率为-0.399%;同期业绩比较基准增长率为1.08%;南方金利定期开放 C 本基金净值增长率为-0.009%;同期业绩比较基准增长率为0.08%。 | | |

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,可简称为“南方金利”。

主要财务指标	报告期(2013年7月1日—2013年9月30日)	单位:人民币元
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	1,327,821.39	8,595,468.02
2.本期利润	-3,981,971.79	-3,252,709.23
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0041	-0.0049
4.期末基金资产净值	1,010,114,825.89	690,794.0133
5.期末基金份额净值	1.032	1.029

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)扣除必要的费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
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,费用计算方法详见本招募说明书“风险揭示”部分。
3.基金净值表现未考虑持有人认购或交易本基金的各项费用,费用计算方法详见本招募说明书“风险揭示”部分。
4.2.4 本期报告期按行业分类的股息率组合情况 | | |

基金简称	南方金利定期开放债券
交易代码	160128
上市交易代码(LOF)	南方金利定期开放(LOF)
基金份额净值	2013/9/30 5.1717
份额期末基金单位总值	1,650,108,892.96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,力求获得高于银行存款利率的稳定收益。
投资策略	本基金以中长期定期开放式为运作方式,在充分分析宏观经济形势的基础上,结合经济周期、宏观政策等方面的变化,通过系统和人工等各种方式在充分考虑各种风险收益因素的基础上,综合运用多种投资技术,在严格控制风险的前提下,力争取得超越基准收益水平的投资回报。
业绩比较基准	三年定期存款利率(税后收益率)
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水平低于股票基金、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
下属分级基金的基金简称	南方金利定期开放债券 A 南方金利定期开放债券 C
下属分级基金的交易代码	160128 160129
报告期末该基金的份额总额	978,706,452.32份 671,941,940.74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,可简称为“南方金利”。

主要财务指标	报告期(2013年7月1日—2013年9月30日)	单位:人民币元
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	1,327,821.39	8,595,468.02
2.本期利润	-3,981,971.79	-3,252,709.23
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0041	-0.0049
4.期末基金资产净值	1,010,114,825.89	690,794.0133
5.期末基金份额净值	1.032	1.029

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)扣除必要的费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
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,费用计算方法详见本招募说明书“风险揭示”部分。
3.基金净值表现未考虑持有人认购或交易本基金的各项费用,费用计算方法详见本招募说明书“风险揭示”部分。
4.2.5 本期报告期按行业分类的股息率组合情况 | | |

基金简称	南方金利定期开放债券
交易代码	160128
上市交易代码(LOF)	南方金利定期开放(LOF)
基金份额净值	2013/9/30 5.1717
份额期末基金单位总值	1,650,108,892.96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,力求获得高于银行存款利率的稳定收益。
投资策略	本基金以中长期定期开放式为运作方式,在充分分析宏观经济形势的基础上,结合经济周期、宏观政策等方面的变化,通过系统和人工等各种方式在充分考虑各种风险收益因素的基础上,综合运用多种投资技术,在严格控制风险的前提下,力争取得超越基准收益水平的投资回报。
业绩比较基准	三年定期存款利率(税后收益率)
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水平低于股票基金、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
下属分级基金的基金简称	南方金利定期开放债券 A 南方金利定期开放债券 C
下属分级基金的交易代码	160128 160129
报告期末该基金的份额总额	978,706,452.32份 671,941,940.74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,可简称为“南方金利”。

主要财务指标	报告期(2013年7月1日—2013年9月30日)	单位:人民币元
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	1,327,821.39	8,595,468.02
2.本期利润	-3,981,971.79	-3,252,709.23
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0041	-0.0049
4.期末基金资产净值	1,010,114,825.89	690,794.0133
5.期末基金份额净值	1.032	1.029