

南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资 基金（LOF）2020 年第 3 季度报告

2020 年 09 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 10 月 28 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|--|----------------|
| 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 | |
| 基金主代码 | 160131 | |
| 交易代码 | 160131 | |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013 年 11 月 28 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 63,390,442.98 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基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。 | |
| 投资策略 | 本基金以中长期利率趋势分析为基础，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 | 1 年期银行定期存款利率(税后)+1.2% | |
| 风险收益特征 | 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。 | |
| 基金管理人 | 南方基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 南方聚利 A | 南方聚利 C |
| 下属分级基金的场内简称 | 南方聚利 | |
| 下属分级基金的交易代码 | 160131 | 160134 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 54,025,963.46 份 | 9,364,479.52 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“南方聚利”。

§ 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（2020 年 7 月 1 日—2020 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|--------------|
| | 南方聚利 A | 南方聚利 C |
| 1. 本期已实现收益 | 318,833.70 | 45,176.78 |
| 2. 本期利润 | 131,147.88 | 12,851.94 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0024 | 0.0014 |
| 4. 期末基金资产净值 | 56,062,269.83 | 9,644,213.58 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.038 | 1.030 |

注：1、上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要低于所列数字；

2、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。

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

南方聚利 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.29% | 0.05% | 0.57% | 0.01% | -0.28% | 0.04% |
| 过去六个月 | 0.29% | 0.06% | 1.13% | 0.01% | -0.84% | 0.05% |
| 过去一年 | 2.89% | 0.06% | 2.29% | 0.01% | 0.60% | 0.05% |
| 过去三年 | 14.28% | 0.08% | 7.20% | 0.01% | 7.08% | 0.07% |
| 过去五年 | 20.72% | 0.09% | 12.62% | 0.01% | 8.10% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 46.55% | 0.10% | 20.71% | 0.01% | 25.84% | 0.09% |

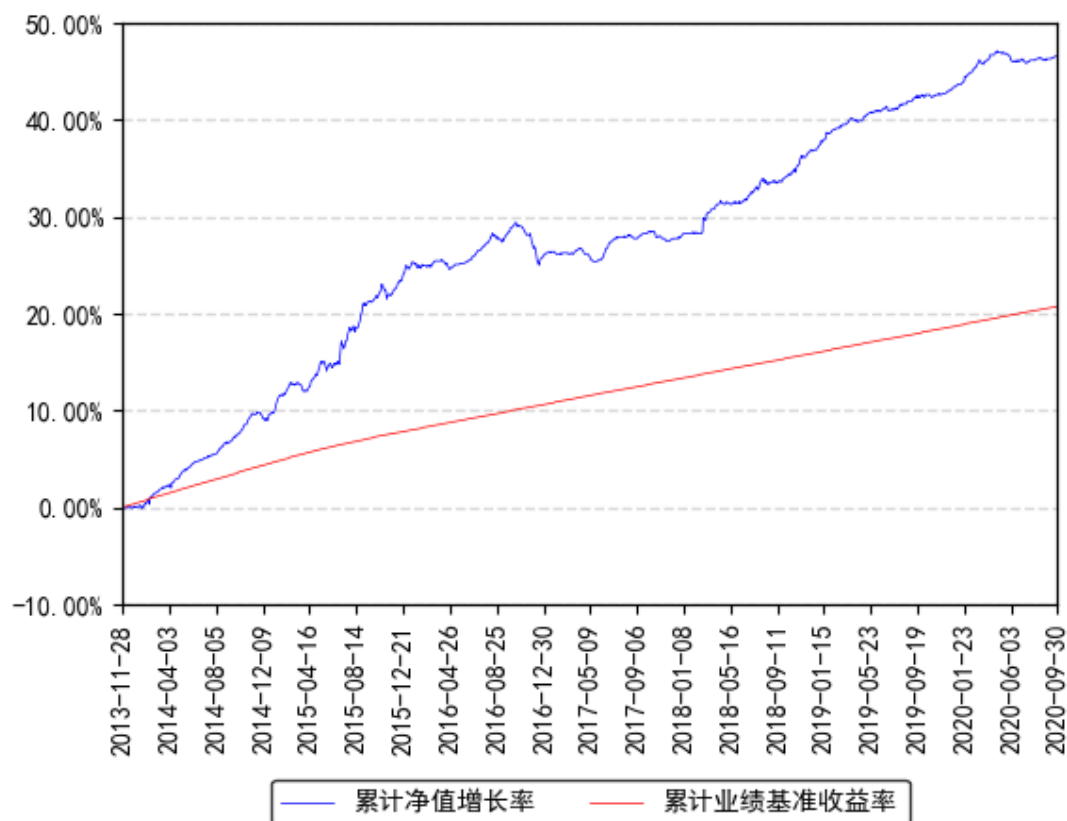
南方聚利 C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

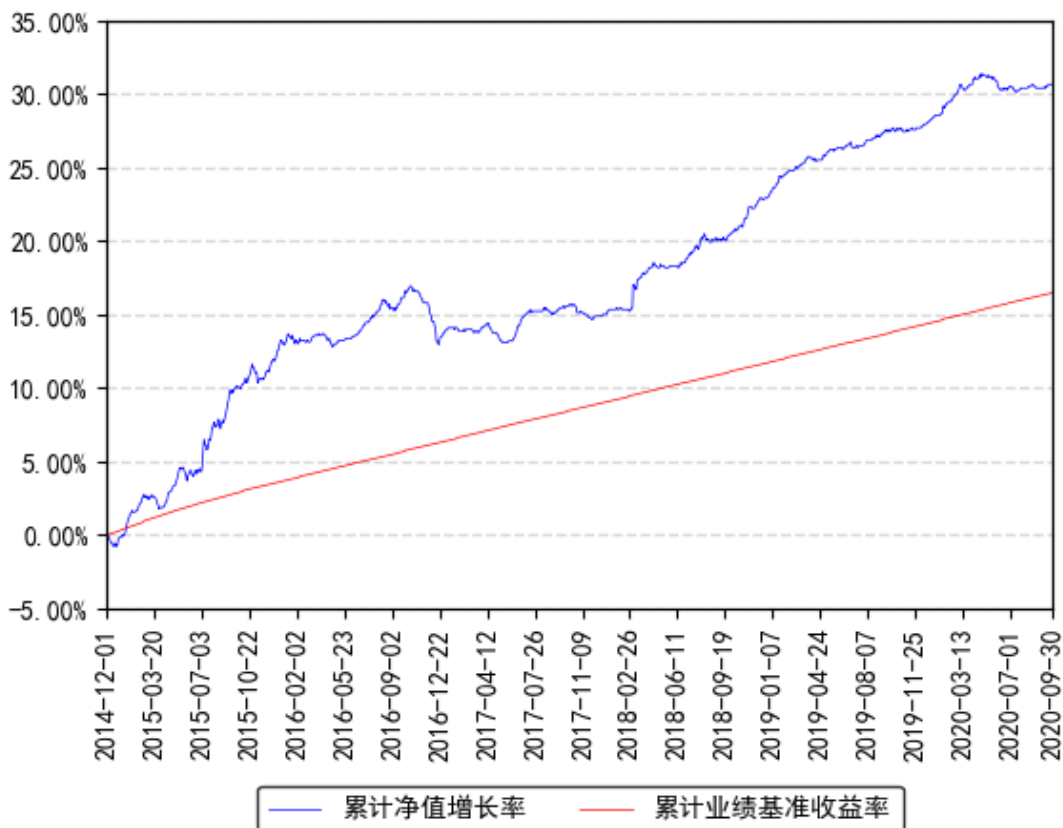
| | | ② | | 准差④ | | |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.10% | 0.04% | 0.59% | 0.01% | -0.49% | 0.03% |
| 过去六个月 | 0.00% | 0.06% | 1.18% | 0.01% | -1.18% | 0.05% |
| 过去一年 | 2.42% | 0.06% | 2.38% | 0.01% | 0.04% | 0.05% |
| 过去三年 | 13.06% | 0.08% | 7.48% | 0.01% | 5.58% | 0.07% |
| 过去五年 | 18.52% | 0.09% | 13.14% | 0.01% | 5.38% | 0.08% |
| 自基金合同 生效起至今 | 30.67% | 0.10% | 16.49% | 0.01% | 14.18% | 0.09% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方聚利A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方聚利C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金自2014年12月1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限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李慧鹏 | 本基金基金经理 | 2019年2月26日 | - | 14年 | 首都经济贸易大学产业经济学硕士，具有基金从业资格。曾就职于联合资信评估有限公司、银华基金管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司、民生加银基金管理有限公司，历任分析师、研究员、信用评级分析师、基金经理。2014年2月24日至2015年4月10日，任泰达宏利收益增强基金经理；2015年7月30日至2018年10月17日，任民生加银平稳增利、民生加银平稳添利基金经理；2016年1月4日至2017年8月21日， |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | 任民生加银新收益基金经理；2016年4月15日至2017年9月29日，任民生加银家盈理财基金经理；2016年6月17日至2017年8月21日，任民生加银鑫瑞基金经理；2016年7月26日至2018年4月26日，任民生加银鑫盈基金经理；2016年9月9日至2017年11月24日，任民生加银鑫安基金经理；2016年10月31日至2018年10月17日，任民生加银鑫享基金经理；2016年12月27日至2018年3月22日，任民生加银岁岁增利基金经理；2017年3月7日至2018年8月21日，任民生加银鑫益基金经理；2017年4月25日至2018年10月17日，任民生加银汇鑫基金经理；2017年6月21日至2018年10月17日，任民生加银鑫元基金经理；2017年7月21日至2017年12月5日，任民生加银鑫成基金经理；2017年7月21日至2017年12月7日，任民生加银鑫兴基金经理；2017年7月24日至2017年12月8日，任民生加银鑫智基金经理；2017年7月28日至2017年12月6日，任民生加银鑫华基金经理；2017年8月9日至2017年12月29日，任民生加银鑫信基金经理。2018年10月加入南方基金；2019年2月26日至今，任南方聚利、南方交元基金经理；2019年6月21日至今，任南方国利基金经理；2019年7月5日至今，任南方初元中短债基金经理；2019年11月5日至今，任南方梦元短债、南方定元中短债基金经理；2019年11月28日至今，任南方皓元短债基金经理。 |
|--|--|--|--|---|

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本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、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度本基金继续保持短久期适度杠杆的基础配置策略，获取较为确定的票息回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金A份额净值为1.038元，报告期内，份额净值增长率为0.29%，同期业绩基准增长率为0.57%；本基金C份额净值为1.030元，报告期内，份额净值增长率为0.10%，同期业绩基准增长率为0.59%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|----|-------|--------------|
|----|----|-------|--------------|

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 76,519,308.30 | 95.62 |
| | 其中：债券 | 73,774,308.30 | 92.19 |
| | 资产支持证券 | 2,745,000.00 | 3.43 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,398,657.94 | 1.75 |
| 8 | 其他资产 | 2,107,019.93 | 2.63 |
| 9 | 合计 | 80,024,986.17 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 14,959,545.00 | 22.77 |
| | 其中：政策性金融债 | 14,959,545.00 | 22.77 |
| 4 | 企业债券 | 43,693,263.30 | 66.50 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,032,000.00 | 15.27 |
| 6 | 中期票据 | 5,089,500.00 | 7.75 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 73,774,308.30 | 112.28 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量 (张) | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|---------|--------------|---------------|
| 1 | 200206 | 20 国开 06 | 100,000 | 9,905,000.00 | 15.07 |
| 2 | 155410 | 19 光大债 | 60,000 | 6,031,200.00 | 9.18 |
| 3 | 101800686 | 18 兖矿 MTN008 | 50,000 | 5,089,500.00 | 7.75 |
| 4 | 108902 | 农发 1802 | 50,500 | 5,054,545.00 | 7.69 |
| 5 | 041900421 | 19 株洲城建 CP002 | 50,000 | 5,032,000.00 | 7.66 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量 (份) | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|--------|--------|--------------|---------------|
| 1 | 138170 | 平汽 3A2 | 50,000 | 2,745,000.00 | 4.18 |

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 4,466.97 |
| 2 | 应收证券清算款 | 393,625.65 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,708,927.31 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,107,019.93 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 南方聚利 A | 南方聚利 C |
|--------------|---------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 53,749,773.39 | 9,339,477.62 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 276,190.07 | 25,001.90 |
| 减：报告期期间基金总赎回 | - | - |

| | | |
|----------------------------|---------------|--------------|
| 份额 | | |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 54,025,963.46 | 9,364,479.52 |

注：本基金自 2014 年 12 月 1 日起增加 C 类份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 2、《南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 3、南方聚利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 2020 年 3 季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

9.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>