

南方理财金交易型货币市场基金

[2015] 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016年3月30日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示
基金管理人的声明：本基金所披露的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、完整性承担个别及连带的责任。本年度报告已三分之二以上独立董事签字确认。
基金管理人：南方基金管理有限公司，经本公司授权，南方基金管理有限公司根据有关法律法规和基金合同的规定，代表本基金向持有人办理基金合同项下的各项事宜。
基金管理人：南方基金管理有限公司根据有关法律法规和基金合同的规定，于2016年3月21日签署了本报告书中的财务数据、利润表现、利得分摊情况、财务费用报告、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信、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，投资者应谨慎选择。

本报告期内自2015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

基金名称	南方理财金货币ETF
场内简称	理财金
基金代码	000816
基金上市方式	契约型开放式(ETF)
基金合同生效日	2014年1月6日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金总资产	648,477,431.52份
基金合同存续期间	不定期
基金上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015-01-06
下属分级基金的基金简称	理财金A
下属分级基金的交易代码	000816 511810
报告期末下属分级基金的份额总额	425,907,584.92份 122,569,846.60份

注1：本基金在交易所行情系统净值揭示栏显示的份额净值含场内申购赎回费用，可简称为“南方理财金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险、保持资产的流动性前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将利用对宏观经济、政策环境、资金面、利率水平、信用利差、债券收益率等指标的分析，结合对不同券种的估值分析，通过久期配置、期限结构配置、券种选择以及个券选择来获取债券市场的平均收益水平。本基金将通过严格的风险预算管理，有效控制本基金的下行风险，同时通过适当的杠杆操作，提高本基金的收益率。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款的到期收益率（税后）。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

4.9 报告期内管理人对本基金进行定期报告的说明

4.9.1 投资人报告

4.9.2 基金管理人对本基金定期报告的说明

4.9.3 基金托管人对本基金定期报告的说明

4.9.4 基金销售机构对本基金定期报告的说明

4.9.5 基金审计报告

4.9.6 基金年度报告

4.9.7 基金年度报告摘要

4.9.8 基金年度报告附录

4.9.9 基金年度报告正文

4.9.10 基金年度报告附录

4.9.11 基金年度报告附录

4.9.12 基金年度报告附录

4.9.13 基金年度报告附录

4.9.14 基金年度报告附录

4.9.15 基金年度报告附录

4.9.16 基金年度报告附录

4.9.17 基金年度报告附录

4.9.18 基金年度报告附录

4.9.19 基金年度报告附录

4.9.20 基金年度报告附录

4.9.21 基金年度报告附录

4.9.22 基金年度报告附录

4.9.23 基金年度报告附录

4.9.24 基金年度报告附录

4.9.25 基金年度报告附录

4.9.26 基金年度报告附录

4.9.27 基金年度报告附录

4.9.28 基金年度报告附录

4.9.29 基金年度报告附录

4.9.30 基金年度报告附录

4.9.31 基金年度报告附录

4.9.32 基金年度报告附录

4.9.33 基金年度报告附录

4.9.34 基金年度报告附录

4.9.35 基金年度报告附录

4.9.36 基金年度报告附录

4.9.37 基金年度报告附录

4.9.38 基金年度报告附录

4.9.39 基金年度报告附录

4.9.40 基金年度报告附录

4.9.41 基金年度报告附录

4.9.42 基金年度报告附录

4.9.43 基金年度报告附录

4.9.44 基金年度报告附录

4.9.45 基金年度报告附录

4.9.46 基金年度报告附录

4.9.47 基金年度报告附录

4.9.48 基金年度报告附录

4.9.49 基金年度报告附录

4.9.50 基金年度报告附录

4.9.51 基金年度报告附录

4.9.52 基金年度报告附录

4.9.53 基金年度报告附录

4.9.54 基金年度报告附录

4.9.55 基金年度报告附录

4.9.56 基金年度报告附录

4.9.57 基金年度报告附录

4.9.58 基金年度报告附录

4.9.59 基金年度报告附录

4.9.60 基金年度报告附录

4.9.61 基金年度报告附录

4.9.62 基金年度报告附录

4.9.63 基金年度报告附录

4.9.64 基金年度报告附录

4.9.65 基金年度报告附录

4.9.66 基金年度报告附录

4.9.67 基金年度报告附录

4.9.68 基金年度报告附录

4.9.69 基金年度报告附录

4.9.70 基金年度报告附录

4.9.71 基金年度报告附录

4.9.72 基金年度报告附录

4.9.73 基金年度报告附录

4.9.74 基金年度报告附录

4.9.75 基金年度报告附录

4.9.76 基金年度报告附录

4.9.77 基金年度报告附录

4.9.78 基金年度报告附录

4.9.79 基金年度报告附录

4.9.80 基金年度报告附录

4.9.81 基金年度报告附录

4.9.82 基金年度报告附录

4.9.83 基金年度报告附录

4.9.84 基金年度报告附录

4.9.85 基金年度报告附录

4.9.86 基金年度报告附录

4.9.87 基金年度报告附录

4.9.88 基金年度报告附录

4.9.89 基金年度报告附录

4.9.90 基金年度报告附录

4.9.91 基金年度报告附录

4.9.92 基金年度报告附录

4.9.93 基金年度报告附录

4.9.94 基金年度报告附录

4.9.95 基金年度报告附录

4.9.96 基金年度报告附录

4.9.97 基金年度报告附录

4.9.98 基金年度报告附录

4.9.99 基金年度报告附录

4.9.100 基金年度报告附录

4.9.101 基金年度报告附录

4.9.102 基金年度报告附录

4.9.103 基金年度报告附录

4.9.104 基金年度报告附录

4.9.105 基金年度报告附录

4.9.106 基金年度报告附录

4.9.107 基金年度报告附录

4.9.108 基金年度报告附录

4.9.109 基金年度报告附录

4.9.110 基金年度报告附录

4.9.111 基金年度报告附录

4.9.112 基金年度报告附录

4.9.113 基金年度报告附录

4.9.114 基金年度报告附录

4.9.115 基金年度报告附录

4.9.116 基金年度报告附录

4.9.117 基金年度报告附录

4.9.118 基金年度报告附录

4.9.119 基金年度报告附录

4.9.120 基金年度报告附录

4.9.121 基金年度报告附录

4.9.122 基金年度报告附录

4.9.123 基金年度报告附录

4.9.124 基金年度报告附录

4.9.125 基金年度报告附录

4.9.126 基金年度报告附录

4.9.127 基金年度报告附录

4.9.128 基金年度报告附录

4.9.129 基金年度报告附录

4.9.130 基金年度报告附录

4.9.131 基金年度报告附录

4.9.132 基金年度报告附录

4.9.133 基金年度报告附录

4.9.134 基金年度报告附录

4.9.135 基金年度报告附录

4.9.136 基金年度报告附录