南方收益宝货币市场基金

【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:中国建设银行股份有限公司
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独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

本基金自2015年7月29日实施份额分类,设置两类基金份额,A类基金份额和B类基金份额。两类份额单独设置基金代码,A类基金份额(现有份额)的基金代码为202307,B类份额为新增基金份额,基金代码为202308。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方收益宝货币市场基金	
基金简称	南方收益宝货币	
基金主代码	202307	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年12月15日	
基金管理人	南方基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	29,927,539,192.67份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	南方收益宝A	南方收益宝B
下属分级基金的交易代码:	202307	202308
报告期末下属分级基金的份额总额	1,454,071,445.22份	28,473,467,747.46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"南方收益宝"。

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险,保持流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在120天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中国人民银行公布的七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金和债券型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文章	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67595096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	010-67595096
传真		0755-82763889	010-66275853
注册地址		深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层	北京市西城区闹市口大街一号院一号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		吴万善	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	南方基金管理有限公司	深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦塔楼31-33层

§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

项目	2015年		2014年12月15日(基金合同生效日)-2014年12月31日
	南方收益宝A	南方收益宝B	南方收益宝
本期已实现收益	31,917,433.14	131,599,820.39	503,109.90
本期利润	31,917,433.14	131,599,820.39	503,109.90
本期净值收益率	3.6086%	1.1690%	0.1813%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末
期末基金资产净值	1,454,071,445.22	28,473,467,747.45	274,645,631.18
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2015年末		2014年末
累计净值收益率	3.7967%	1.1690%	0.1813%

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
2、本基金自2015年7月29日实施份额分类,设置两类基金份额,A类基金份额和B类基金份额。
3、本基本利润分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

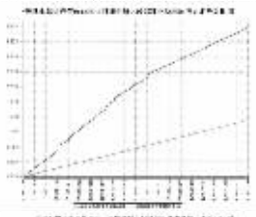
南方收益宝A

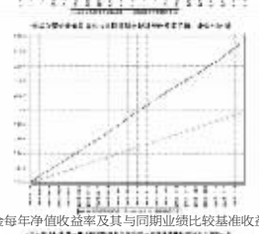
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2285%	0.0015%	0.1163%	-	0.1122%	0.0015%
过去三个月	0.6406%	0.0010%	0.3456%	-	0.2950%	0.0010%
过去六个月	1.3699%	0.0059%	0.6924%	-	0.6775%	0.0059%
过去一年	3.6086%	0.0087%	1.3781%	-	2.2305%	0.0087%
自基金合同生效起至今	3.7967%	0.0085%	1.4428%	-	2.3539%	0.0085%

南方收益宝B

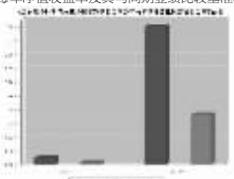
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2492%	0.0015%	0.1163%	-	0.1329%	0.0015%
过去三个月	0.7020%	0.0010%	0.3456%	-	0.3564%	0.0010%
过去六个月	1.1690%	0.0008%	0.5829%	-	0.5861%	0.0008%
自基金合同生效起至今	1.1690%	0.0008%	0.5829%	-	0.5861%	0.0008%

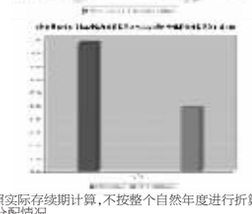
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





3.2.3 自基金转型以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注:基金合同生效当年按照实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

南方收益宝A

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015	31,917,433.14	-	-	31,917,433.14	
合计	31,917,433.14	-	-	31,917,433.14	

单位:人民币元

南方收益宝A

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015年2月29日(新增份额类别)-2015年12月31日	131,599,820.39	-	-	131,599,820.39	
合计	131,599,820.39	-	-	131,599,820.39	

单位:人民币元

南方收益宝

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014年12月15日(基金合同生效日)-2014年12月31日	1,173,449.93	8,752.25	-679,092.28	503,109.90	

注:本基金B类基金份额为自2015年7月29日起新增的份额类别(以下简称"B类基金份额"或"南方收益宝B")。具体见本公司2015年7月29日发布的《关于南方收益宝货币市场基金降低基金管理费率和托管费率、实施份额分类并修改基金合同的公告》。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日,经中国证监会批准,南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立,成为我国"新基金时代"的起始标志。

南方基金总部设在深圳,注册资本3亿元人民币。股东结构为:华泰证券股份有限公司(45%);深圳市投资控股有限公司(30%);厦门国际信托有限公司(15%);兴业证券股份有限公司(10%)。目前,公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司,在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中,南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末,南方基金管理有限公司(不含子公司)管理资产规模超过5,000亿元,旗下管理85只开放式基金,多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
夏晨曦	本基金基金经理	2014年12月15日	-	10年	香港科技大学理学硕士,具有基金从业资格。2005年5月加入南方基金,曾担任金融工程研究员、固定收益研究员、风险控制岗等职务,现任固定收益部总监助理。2008年5月至2012年7月,任国定收益投资经理,负责社保、专户及年金组合的投资管理;2012年7月至2015年1月,任南方洞元基金经理;2012年8月至今,任南方理财14天基金经理;2012年10月至今,任南方理财60天基金经理;2013年1月至今,任南方收益宝基金经理;2014年7月至今,任南方现金增利基金经理;2014年7月至今,任南方新金宝基金经理;2014年12月至今,任南方理财金基金经理。

注:1. 对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期,除首任基金经理外,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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《南方收益宝货币市场基金基金合同》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,为基金持有人谋求最大利益。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。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定,针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动,以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节,建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则,投资管理制度和细则,集中交易管理办法,公平交易操作指引,异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。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。

4.3.2 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。

公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内,两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在,并且交易占优比也没有明显异常,未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 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%的交易次数为9次,其中5次是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致,2次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致,2次是由于投资组合的投资策略需要,相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2015年,经济增速进一步下台阶,总需求大幅下滑。受大宗商品持续下跌和国内需求疲弱影响,PPI同比增速继续为负,且跌幅进一步扩大,CPI仍向通缩方向发展。低增长、低通胀的基本面环境下,货币市场走势主要分为三个阶段,第一阶段,一季度货币市场流动性呈偏紧状态,在美元走强的背景下,央行总量政策以对冲为主,叠加资本市场资金需求旺盛,使得货币市场利率高位运行,短端曲线倒挂。第二阶段,二季度开始经济下行压力进一步加大,央行开始通过公开市场释放明确的放松信号,并通过持续性的降准、降息政策引导市场利率大幅下行。第三阶段,7月份股票市场大幅下跌,市场避险情绪浓厚,资本市场资金需求持续萎缩,大类资产出现了显著切换,与此同时经济持续低迷,央行仍保持了相对宽松的货币环境,市场流动性平稳,货币市场利率维持窄幅震荡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

在本报告期内,南方收益宝货币A级基金净值收益率为3.6086%,同期业绩比较基准收益率为1.3781%;南方收益宝货币B级基金净值收益率为1.1690%,同期业绩比较基准收益率为0.5829%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年,基本面环境大概率上仍将延续低增长、低通胀的状态,国际环境不确定性加大,人民币汇率贬值压力仍然存在。政策层面,在供给侧改革背景下,货币政策进一步发力的空间相对有限,关注点应在财政政策的定点发力上。我们认为,货币政策将着力稳定流动性预期,并重点通过价格型工具构建利率走廊。此外,信用债品种在供给侧改革、去产能、去库存、去杠杆的大背景下,低等级债券的信用风险将持续发酵。就组合操作来看,我们将密切跟踪货币市场利率的趋势性变化,着力提升组合的静态收益水平,并积极把握短期的波段操作机会,博取超额收益。同时高度关注持仓债券的信用风险,在持仓结构上以中高等级债券为主。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人严格遵守相关法律法规,坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发,依照公司内部控制的整体要求,继续致力于内控机制的完善,加强内部风险的控制与防范,确保各项法规和管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行。

本报告期内,本基金管理人开展了基金管理公司合规风险全面自查、分级基金折算自查等多项内控自查工作、制定或修订了合规手册、公平交易操作指引、股票池管理制度等内部制度,进一步完善了公司的内控体系;对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核,检查业务开展的合规性和制度执行的有效性;采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作,加强对日常投资运作的管理和监控,督促投研交易业务的合规开展;针对新出台的法律法规和监管要求,积极组织了多项法律法规、职业道德培训以及合规考试,不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养;全面参与新产品设计、新业务拓展工作;严格审查基金宣传推介材料,及时检查基金销售业务的合法合规情况;完成各项信息披露工作,保证所披露信息的真实性、准确性和完整性;监督客户投诉处理,重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,积极健全内部管理制度,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范各种风险,切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括副总经理、研究部总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中,超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同约定,本基金采用"每日分配、按日支付",即根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,且每日进行支付。

本报告期内应分配收益163,517,253.53元,实际分配收益163,517,253.53元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》,基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期,南方收益宝实施利润分配的金额为163,517,253.53元,其中,南方收益宝A类为31,917,433.14元,南方收益宝B类为131,599,820.39元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第21284号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方收益宝货币市场基金(原南方理财30天债券型证券投资基金)全体基金份额持有人:
引言段	我们审计了后附的,南方收益宝货币市场基金(以下简称"南方收益宝基金")的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是南方收益宝基金的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计色当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述南方收益宝基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了南方收益宝基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞 陈熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国·上海市
审计报告日期	2016年3月25日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:南方收益宝货币市场基金
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	13,483,277,933.03	48,482,853.80
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	4,644,237,259.76	149,953,246.52
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,644,237,259.76	149,953,246.52
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	11,764,968,193.85	96,758,385.14
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	37,865,087.84	2,906,371.37
应收股利		-	-
应收申购款		-	20,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	477.50	-
资产总计		29,930,348,951.98	298,120,856.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	22,999,645.50
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		101,843.89	10,004.42
应付管理人报酬		1,481,043.63	66,790.14
应付托管费		528,944.19	22,396.61
应付销售服务费		371,437.80	67,693.93
应付交易费用	7.4.7.7	124,469.56	19,095.37
应交税费		-	-
应付利息		-	5,481.10
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	202,020.24	284,118.58
负债合计		2,809,759.31	23,475,225.65
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	29,927,539,192.67	274,645,631.18
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		29,927,539,192.67	274,645,631.18
负债和所有者权益总计		29,930,348,951.98	298,120,856.83

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额29,927,539,192.67份,其中A类基金份额总额1,454,071,445.22份,B类基金份额总额28,473,467,747.45份。

7.2 利润表

会计主体:南方收益宝货币市场基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年12月15日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入		185,233,755.04	658,334.22
1.利息收入		181,767,892.57	664,073.65
其中:存款利息收入	7.4.7.11	124,097,881.69	136,083.65
债券利息收入		23,443,987.27	303,147.92
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		34,226,023.61	224,842.08
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		3,459,401.80	-5,739.43
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,459,401.80	-5,739.43
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	6,460.67	-
减:二、费用		21,716,501.51	155,224.32
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,669,296.80	35,193.47
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,106,117.56	13,034.62
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	3,472,989.38	32,586.53
4. 交易费用	7.4.7.19	150.00	-
5. 利息支出		5,949,394.23	33,124.14
其中:卖出回购金融资产支出		-	33,124.14
6. 其他费用	7.4.7.20	518,553.54	41,285.56
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		163,517,253.53	503,109.90
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		163,517,253.53	503,109.90

注:上年度可比期间为2014年12月15日(基金合同生效日)至2014年12月31日

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方收益宝货币市场基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	274,645,631.18	-	274,645,631.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	163,517,253.53	163,517,253.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	29,652,893,561.49	-	29,652,893,561.49
其中:1.基金申购款	71,398,759,733.15	-	71,398,759,733.15
2.基金赎回款	-41,745,866,171.66	-	-41,745,866,171.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-163,517,253.53	-163,517,253.53
五、期末所有者权益(基金净值)	29,927,539,192.67	-	29,927,539,192.67

项目	上年度可比期间 2014年12月15日(基金合同生效日)至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	315,987,611.19	-	315,987,611.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	503,109.90	503,109.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-41,341,980.01	-	-41,341,980.01
其中:1.基金申购款	117,148,238.30	-	117,148,238.30
2.基金赎回款	-158,490,218.31	-	-158,490,218.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-503,109.90	-503,109.90
五、期末所有者权益(基金净值)	274,645,631.18	-	274,645,631.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 务报表由下列负责人签署:

杨小松 徐超 徐超
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方收益宝货币市场基金是根据原南方理财30天债券型证券投资基金(以下简称"南方理财30天基金")基金份额持有人大会2014年11月14日以现场方式审议通过的《南方理财30天债券型证券投资基金转型有关事项的议案》,并经中国证监会证监许可[2014]1025号《关于准予南方理财30天债券型证券投资基金变更注册的批复》核准,由原基金南方理财30天基金转型而来。原南方理财30天基金为契约型定期开放式基金,存续期限不定,经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,自2014年12月15日起,南方理财30天基金更名为南方收益宝货币市场基金(以下简称"本基金"),原《南方理财30天债券型证券投资基金基金合同》失效,《南方收益宝货币市场基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方收益宝货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行存款和大额存单、剩余期限在397天以内(含397天)的债券和中期票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、短期融资券以及法律法规或中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款税后利率。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于2016年3月25日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方收益宝货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2014年12月15日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息,按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价;同时于每一计价日计算影子价格,以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果,基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的0.25%时,基金管理人应根据风险控制的需要调整组合,使基金资产净值重偏公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。