基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
送出日期:2016年3月30日

南方薪金宝货币市场基金

2015 年度报告摘要

§1 重要提示

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。

基金托管人中信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。

本报告期自2015年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方薪金宝货币
基金主代码	000837
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月23日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,477,727,833.18份
基金合同存续期	不定期

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“南方薪金宝”。

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,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同期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型基金、混合型基金和债券型基金。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	方晖
	联系电话	0755-82763888	010-89936330
	电子邮箱	manager@southernfund.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		400-889-8899	95568
传真		0755-82763889	010-66560832

2.4 信息披露方式

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

§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

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年6月23日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	67,616,350.83	11,639,511.25
本期利润	67,616,350.83	11,639,511.25
本期净值收益率	3.7870%	2.0716%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末
期末基金资产净值	2,477,727,833.18	1,014,256,135.54
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注: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,由于货币市场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。

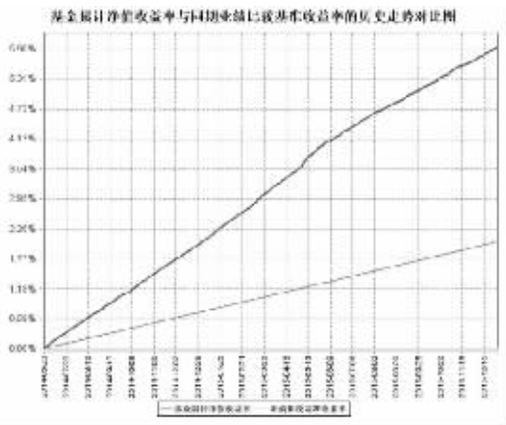
3.2 基金净值表现

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

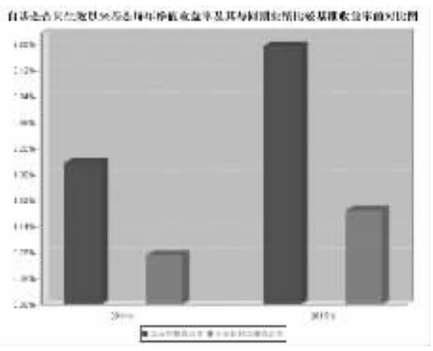
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.75487%	0.00533%	0.34546%	0.00000%	0.40942%	0.00533%
过去六个月	1.56437%	0.00481%	0.69244%	0.00000%	0.87193%	0.00481%
过去一年	3.7870%	0.00456%	1.37911%	0.00000%	2.40959%	0.00456%
自基金合同生效起至今	5.93770%	0.00481%	2.11107%	0.00000%	3.82663%	0.00481%

注:本基金收益分配为按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效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 自基金合同生效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

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	年末利润分配合计	备注
2015	67,616,350.83	-	-	67,616,350.83	
2014	11,639,511.25	-	-	11,639,511.25	
合计	79,255,862.08	-	-	79,255,862.08	

§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7月25日	-	10年	香港科技大学理学硕士,具有基金从业资格。2006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、风险控制员等职务,现任固定收益部总助理兼任2008年6月至2012年7月,任纯债收益部投资经理,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,任南方润元基金经理;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,任南方现金通基金经理;2014年7月至今,任南方薪金宝基金经理;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,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,“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《南方薪金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

本报告期基金净值收益率为3.7870%,同期业绩比较基准收益率为1.3781%。

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。

4.7 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67,616,350.83元,实际分配收益67,616,350.83元。

4.8 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,基金托管人在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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,南方基金管理有限公司在本基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金分配收益67,616,350.83元,符合基金合同的规定。

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

本报告期,由南方基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关本基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

本基金2015年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2016)第21280号“标准无保留意见的审计报告”,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:南方薪金宝货币市场基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	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	955,407,446.58	371,244,741.39
结算备付金	809,523.81	
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,725,398,128.08	555,515,544.85
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,725,398,128.08	555,515,544.85
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	249,131,252.20	230,896,346.34
应收证券清算款	-	-
应收利息	14,705,844.49	9,515,812.45
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	10,000.00	10,000.00
资产总计	2,944,462,195.16	1,167,182,445.03
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	464,998,502.50	152,139,251.79
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	697,183.27	271,147.19
应付托管费	211,267.67	82,165.79
应付销售服务费	528,169.16	205,414.55
应付交易费用	35,957.80	28,643.21
应交税费	-	-
应付利息	72,281.58	44,686.96
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	191,000.00	155,000.00
负债合计	466,734,361.98	152,926,309.49
所有者权益:		
实收基金	2,477,727,833.18	1,014,256,135.54
未分配利润	-	-
所有者权益合计	2,477,727,833.18	1,014,256,135.54
负债和所有者权益总计	2,944,462,195.16	1,167,182,445.03

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2,477,727,833.18份。

7.2 利润表

会计主体:南方薪金宝货币市场基金

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	上年度可比期间 2014年6月23日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	85,811,536.87	14,659,768.03
1.利息收入	72,118,040.14	13,934,874.59
其中:存款利息收入	31,181,829.16	8,458,070.58
债券利息收入	36,874,913.56	3,908,359.66
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,061,297.42	1,568,444.35
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	13,693,496.73	724,893.44
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	13,693,496.73	724,893.44
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-
减:二、费用	18,195,186.04	3,020,256.78
1. 管理人报酬	6,281,184.14	983,793.90
2. 托管费	1,903,389.12	298,119.34
3. 销售服务费	4,758,472.86	745,298.41
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	4,752,565.49	755,178.88
其中:卖出回购金融资产支出	4,752,565.49	755,178.88
6. 其他费用	499,574.43	237,866.25
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	67,616,350.83	11,639,511.25
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	67,616,350.83	11,639,511.25

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方薪金宝货币市场基金

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)	1,014,256,135.54	-	1,014,256,135.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	67,616,350.83	67,616,350.83
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)	1,463,471,697.64	-	1,463,471,697.64
其中:1.基金申购款	22,163,028,169.12	-	22,163,028,169.12
2.基金赎回款	-20,699,556,471.48	-	-20,699,556,471.48
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)	-	-67,616,350.83	-67,616,350.83
五、期末所有者权益(基金净值)	2,477,727,833.18	-	2,477,727,833.18
项目	上年度可比期间 2014年6月23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)	271,875,150.13	-	271,875,150.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,639,511.25	11,639,511.25
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)	742,380,985.41	-	742,380,985.41
其中:1.基金申购款	4,047,294,823.60	-	4,047,294,823.60
2.基金赎回款	-3,304,913,838.19	-	-3,304,913,838.19
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)	-	-11,639,511.25	-11,639,511.25
五、期末所有者权益(基金净值)	1,014,256,135.54	-	1,014,256,135.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.4.1.2 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年6月23日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,281,184.14	983,793.90
其中:支付销售机构的客户维护费	4,463,087.86	616,133.09

注:支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日的基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年6月23日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,903,389.12	298,119.34

注:支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

7.4.4.2.3 销售服务费

金额单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
南方基金	277,821.45
中信银行	4,480,651.41
合计	4,758,472.86
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2014年6月23日(基金合同生效日)至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
南方基金	743,887.77
中信银行	-
合计	743,887.77

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中信银行	119,851,027.33	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2014年6月23日(基金合同生效日)至2014年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中信银行	-	-	-	-	-	-

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

注:本基金的各关联方于本报告期内及上年度可比期间未投资本基金。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年6月23日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	435,407,446.58	4,764,229.89	244,741.39	1,052,538.15

注:本基金的活期存款和部分定期存款由基金托管人中信银行保管,按银行同业利率/约定利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

注:本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.5 (2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本报告期末及上年度末未持有因认购新发/增发证券流通受限证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末及上年度末未持有暂时停牌等流通受限证券。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额464,998,502.50 元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
011506002	15电网SCP002	2016年1月6日	99.96	1,000,000	99,957,036.98
011523005	15大唐SCP005	2016年1月6日	99.99	500,000	49,993,830.44
011586011	15光明SCP011	2016年1月6日	99.76	500,000	49,879,102.49
130215	13国开15	2016年1月4日	100.08	500,000	50,042,280.08
011515010	15中铝业SCP010	2016年1月4日	99.87	400,000	39,949,368.47
110221	11国开21	2016年1月4日	100.1	400,000	40,041,066.75
130250	13国开50	2016年1月4日	100.71	300,000	30,212,280.48
041561020	15华信资产CP001	2016年1月4日	99.98	200,000	19,996,624.29
041575001	15昆钢CP001	2016年1月4日	99.98	200,000	19,995,185.52
150315	15进出15	2016年1月4日	99.5	200,000	19,900,347.06
130235	13国开35	2016年1月4日	98.73	200,000	19,746,874.55
071521008	15渤海证券CP008	2016年1月4日	99.99	100,000	9,998,525.75
130216	13国开16	2016年1月4日	100.21	100,000	10,020,935.36
150215	13国开15	2016年1月4日	100.08	50,000	5,004,228.01
合计				4,650,000	464,737,686.23

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

注:本基金本报告期末及上年度末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,725,398,128.08	58.60
	其中:债券	1,725,398,128.08	58.60
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	249,131,252.20	8.43
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	956,216,970.39	32.48
4	其他各项资产	14,715,844.49	0.50
5	合计	2,944,462,195.16	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	10.74	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	464,998,502.50	18.77
	其中:买断式回购融资	-	

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本基金合同约定:“本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	109
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本基金合同约定:“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”。本报告期内,本基金未发生超标情况。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	27.00	18.77
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.20	-
2	30天(含)—60天	3.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.80	-
3	60天(含)—90天	22.29	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	50.83	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	14.41	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		118.24	18.77

8.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	179,963,994.96	7.26
	其中:政策性金融债	179,963,994.96	7.26
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,149,706,631.86	46.40
6	中期票据	-	-
7	同业存单	395,727,501.27	15.97
8	其他	-	-
9	合计	1,725,398,128.08	69.64
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	49,668,156.97	2.00

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	071530007	15财通证券CP007	1,000,000	99,994,726.97	4.04
2	011514006	15中船SCP006	1,000,000	99,967,506.46	4.03
3	011506002	15电网SCP002	1,000,000	99,957,036.98	4.03
4	011537008	15中建材SCP008	1,000,000	99,940,231.36	4.03
5	111519187	15包商银行CD018	1,000,000	97,460,727.96	3.93
6	011598145	15山钢SCP009	800,000	79,975,975.56	3.23
7	011599543	15陕延油SCP002	700,000	69,922,012.87	2.82
8	130215	13国开15	500,000	50,042,280.08	2.02
9	111513027	15浙商CD027	500,000	50,028,619.08	2.02
10	011524004	15内创SCP004	500,000	50,024,964.12	2.02

8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	30
报告期内偏离度的最高值	0.4004%
报告期内偏离度的最低值	-0.0342%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1642%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1

本基金采用“摊余成本法”计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益。

8.8.2

本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

8.8.3

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

8.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	14,705,844.49
4	应收申购款	-
5	其他应收款	10,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	14,715,844.49

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|