南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金 2016年年度报告摘要

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2017年3月30日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月27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。

本报告期自2016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

基金名称	南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金	
基金简称	南方中债中期票据指数债券发起式	
基金主代码	000022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年5月3日	
基金管理人	南方基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	47,326,942.78份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	南方中债中期票据指数债券发起式A	南方中债中期票据指数债券发起式C
下属分级基金的交易代码:	000022	000023
报告期末下属分级基金的份额总额	39,608,015.98份	7,718,926.80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"南方中票"。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求取得在扣除各项费用之前与标的指数相似的总回报。
投资策略	本基金为被动式指数基金,主要采用抽样复制法,以标的指数的成份券为基础,综合考虑债券利息类型、债券主体资质、债券剩余期限和债券流动性等因素构建组合,并根据本基金日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间债券交易特性及交易费用等情况,进行优化操作,以力争对标的指数的有效跟踪。
业绩比较基准	中债-新中期票据总指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
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。本基金主要采用抽样复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	王永民
	联系电话	0755-82763888	010-66594896
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tcid@bankofchina.com
客户服务电话?		400-889-8899	95566
传真		0755-82763889	010-66594942

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	基金管理人的办公地址、托管人住所

§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

31.1 期间数据和指标	2016年		2015年		2014年	
	南方中债中期票据指数债券发起式A	南方中债中期票据指数债券发起式C	南方中债中期票据指数债券发起式A	南方中债中期票据指数债券发起式C	南方中债中期票据指数债券发起式A	南方中债中期票据指数债券发起式C
本期已实现收益	1,707,939.59	343,116.94	4,393,287.44	701,680.09	8,767,254.53	1,737,598.16
本期利润	-392,441.25	-94,230.80	5,272,360.86	740,057.66	21,582,660.27	2,530,436.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0080	-0.0087	0.0826	0.0690	0.1002	0.0760
本期加权平均净值利润率	-0.68%	-0.75%	7.36%	6.18%	9.57%	7.21%
本期基金份额净值增长率	-1.12%	-1.36%	7.18%	6.95%	8.41%	8.12%
31.2 ?期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
期末可供分配利润	6,100,465.75	1,105,680.06	8,004,271.44	1,243,350.10	8,229,479.89	786,950.85
期末可供分配基金份额利润	0.1540	0.1432	0.1350	0.1270	0.0668	0.0616
期末基金资产净值	45,708,481.73	8,824,606.86	69,208,911.88	11,348,051.35	134,250,731.72	13,846,504.45
期末基金份额净值	1.1540	1.1432	1.1671	1.1590	1.0889	1.0837
31.3?? 累计期末指标	2016年末		2015年末		2014年末	
基金份额累计净值增长率	15.40%	14.32%	16.71%	15.90%	8.89%	8.37%

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

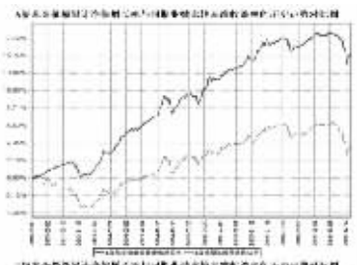
南方中债中期票据指数债券发起式A

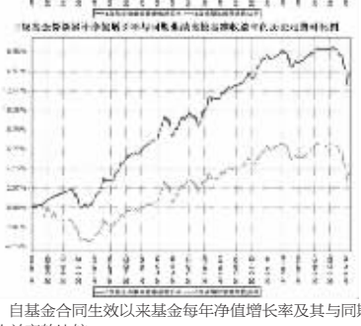
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.07%	0.14%	-2.58%	0.13%	0.51%	0.01%
过去六个月	-1.33%	0.10%	-1.72%	0.10%	0.39%	0.00%
过去一年	-1.12%	0.09%	-2.01%	0.09%	0.89%	0.00%
过去三年	14.89%	0.09%	7.76%	0.08%	7.13%	0.01%
自基金合同生效起至今	15.40%	0.08%	3.83%	0.08%	11.57%	0.00%

南方中债中期票据指数债券发起式C

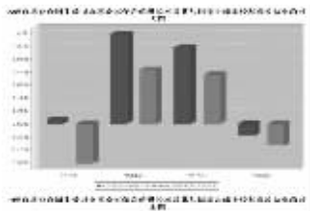
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.13%	0.14%	-2.58%	0.13%	0.45%	0.01%
过去六个月	-1.45%	0.10%	-1.72%	0.10%	0.27%	0.00%
过去一年	-1.36%	0.09%	-2.01%	0.09%	0.65%	0.00%
过去三年	14.06%	0.09%	7.76%	0.08%	6.30%	0.01%
自基金合同生效起至今	14.32%	0.08%	3.83%	0.08%	10.49%	0.00%

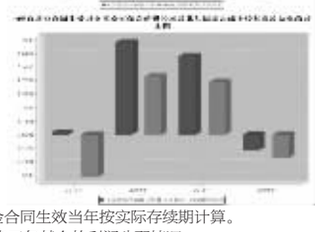
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长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实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:无。

§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)管理资产规模近6,500亿元,旗下管理116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		
董浩	本基金基金经理	2015年9月11日	-	6年	南开大学金融学硕士,具有基金从业资格。2010年7月加入南方基金,历任交易管理岗债券交易员、固定收益岗货币理财类研究员;2014年3月至2015年9月,任南方现金通基金经理助理;2015年9月至2016年8月,任南方50债基金经理;2015年9月至今,任南方现金通、南方中票基金经理;2016年2月至今,任南方日添益货币基金经理;2016年8月至今,任南方10年国债基金经理;2016年11月至今,任南方理财60天基金经理。

§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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本基金2016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(2017)第21514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:南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金
报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产:		
银行存款	373,051.04	910,836.37
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	54,972,450.00	103,773,000.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	54,972,450.00	103,773,000.00
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	802,088.77	1,973,420.44
应收股利	-	-
应收申购款	108,076.63	964,813.64
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	56,255,666.44	107,622,070.45
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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	1,200,000.00	25,699,761.45
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	179,214.22	1,104,409.96
应付管理人报酬	23,203.37	33,579.38
应付托管费	4,640.71	6,715.87
应付销售服务费	2,158.66	2,560.23
应付交易费用	7,699.24	12,925.75
应交税费	-	-
应付利息	576.99	4,320.08
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	305,084.66	200,844.50
负债合计	1,722,577.85	27,065,107.22
所有者权益:		
实收基金	47,326,942.78	69,089,993.07
未分配利润	7,206,145.81	11,466,970.16
所有者权益合计	54,533,088.59	80,556,963.23
负债和所有者权益合计	56,255,666.44	107,622,070.45

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额总额47,326,942.78份,其中A类基金份额总额为39,608,015.98份,基金份额净值1.1540元;C类基金份额总额为7,718,926.80份,基金份额净值1.1432元。

7.2 利润表

会计主体:南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金
本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入	1,043,691.35	7,715,418.29
1.利息收入	3,701,557.26	5,076,059.32
其中:存款利息收入	29,152.10	6,639.17
债券利息收入	3,625,194.41	5,064,770.15
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	47,210.75	4,650.00
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-192,498.23	1,625,810.42
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-192,498.23	1,625,810.42
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)	-2,537,728.58	917,450.99
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	72,360.90	96,097.56
减:二、费用	1,530,363.40	1,702,999.77
1. 管理人报酬	354,969.42	422,213.88
2. 托管费	70,991.88	84,442.78
3. 销售服务费	38,415.11	36,165.41
4. 交易费用	2,282.19	5,125.00
5. 利息支出	462,953.36	560,677.67
其中:卖出回购金融资产支出	462,953.36	560,677.67
6. 其他费用	600,761.44	594,375.03
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-486,672.05	6,012,418.52
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-486,672.05	6,012,418.52

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金
本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	69,089,993.07	11,466,970.16	80,556,963.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-486,672.05	-486,672.05
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)	-21,763,050.29	-3,774,152.30	-25,537,202.59
其中:1.基金申购款	198,891,369.40	32,066,671.73	230,948,031.13
2.基金赎回款	-220,654,419.69	-35,840,824.03	-256,495,233.72
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	47,326,942.78	7,206,145.81	54,533,088.59
项目	上年度可比期间 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)	136,062,040.65	12,035,195.52	148,097,236.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,012,418.52	6,012,418.52
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)	-66,972,047.58	-6,580,643.88	-73,552,691.46
其中:1.基金申购款	258,270,668.69	30,314,822.30	288,585,490.99
2.基金赎回款	-325,242,716.27	-36,895,466.18	-362,138,182.45
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	69,089,993.07	11,466,970.16	80,556,963.23

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前,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。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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
中国银行股份有限公司("中国银行")	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("兴业证券")	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

注:无。

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:本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.4.1.2 债券交易

注:无。

7.4.4.1.3 债券回购交易

注:无。

7.4.4.1.4 权证交易

注:无。

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

注:无。

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	354,969.42	422,213.88
其中:支付销售机构的客户维护费	97,782.34	123,613.09

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0.5%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=前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	70,991.88	84,442.78

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%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 0.1% / 当年天数。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中债中期票据指数债券发起式A	南方中债中期票据指数债券发起式C	合计
中国银行	-	3,560.69	3,560.69
南方基金	-	4,965.80	4,965.80
华泰证券	-	168.23	168.23
兴业证券	-	3.66	3.66
合计	-	8,698.38	8,698.38
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	南方中债中期票据指数债券发起式A	南方中债中期票据指数债券发起式C	合计
中国银行	-	5,962.79	5,962.79
南方基金	-	2,186.15	2,186.15
华泰证券	-	331.26	331.26
兴业证券	-	7.20	7.20
合计	-	8,487.40	8,487.40

注:支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给南方基金,再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为:

日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

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

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	南方中债中期票据指数债券发起式A	南方中债中期票据指数债券发起式C
期初持有的基金份额	10,003,694.81	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,003,694.81	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	25.2567%	-

项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	南方中债中期票据指数债券发起式A	南方中债中期票据指数债券发起式C
基金合同生效日(2013年5月3日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,003,694.81	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,003,694.81	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.8701%	-

注:分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数即期末基金份额总额。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
中国银行	373,051.04	8,213.92	910,836.37	6,037.78

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

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

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 利润分配情况

注:本基金本报告期内无利润分配。

7.4.6 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额1,200,000.00元,于2017年1月11日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为54,972,450.00元,无属于第一或第三层次的余额(2015年12月31日:第二层次103,773,000.00元,无第一和第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	54,972,450.00	97.72
	其中:债券	54,972,450.00	97.72
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	373,051.04	0.66
7	其他各项资产	910,165.40	1.62
8	合计	56,255,666.44	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本基金本报告期末未持有股票。

8.5 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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,495,450.00	6.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	51,477,000.00	94.40
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	54,972,450.00	100.81

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	占基金资产净值比例(%)
1	1182085	11华润MTN1	100,000	10,711,000.00	19.64
2	101353010	13中煤MTN002	100,000	10,358,000.00	18.99
3	101453020	14南电MTN002	100,000	10,336,000.00	18.96
4	101570007	15光明MTN001	100,000	10,038,000.00	18.41
5	101451056	14联通MTN003	100,000	10,034,000.00	18.40

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

本基金本报告期末未持有股票。

8.11.3 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	应收股利	-
4	应收利息	802,088.77
5	应收申购款	108,076.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	910,165.40

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

§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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占份额比例	持有份额	占份额比例
南方中债中期票据指数债券发起式A	5,404	7,329.39	10,013,222.45	25.28%	29,594,793.53	74.72%
南方中债中期票据指数债券发起式C	1,900	4,062.59	-	-	7,718,926.80	100.00%
合计	7,304	6,479.59	10,013,222.45	21.16%	37,313,720.33	78.84%

注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方中债中期票据指数债券发起式A	2,019.61	0.0051%
	南方中债中期票据指数债券发起式C	8.69	0.0001%
	合计	2,028.30	0.0043%

注:1. 分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

2.本公司高级管理人员、本基金基金经理、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注:本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,003,694.81	21.14	10,003,694.81	21.14	自基金合同生效日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,003,694.81	21.14	10,003,694.81	21.14	-

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	南方中债中期票据指数债券发起式A	南方中债中期票据指数债券发起式C
基金合同生效日(2013年5月3日)基金份额总额	1,886,812,578.15	326,158,154.35
本报告期期初基金份额总额	59,298,429.69	9,791,563.38
本报告期基金总申购份额	167,397,673.91	31,493,685.49
减:本报告期基金总赎回份额	187,088,087.62	33,566,322.07
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	39,608,015.98	7,718,926.80

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据南方基金管理有限公司第七届董事会第一次会议审议通过、并按规定向中国证券监督管理委员会深圳监管局备案,基金管理人于2016年10月20日发布公告,自2016年10月18日起,张海波先生担任本基金管理人董事长,吴万善先生不再担任本基金管理人董事长。 基金管理人于2016年10月20日发布公告,南方基金管理有限公