南方利鑫灵活配置混合型证券投资基金 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2016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	南方利鑫灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	南方利鑫灵活配置混合
基金主代码	001334
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月20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	1,039,483,199.92份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称:	南方利鑫A 南方利鑫C
下属分级基金的交易代码:	001334 001503
报告期末下属分级基金的份额总额	1,039,483,199.92份 0.00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“南方利鑫”。

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下,通过专业化研究分析及投资,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:人民币三年期定期存款利率(税后)+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。

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	fcid@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	基金管理人及基金托管人住所

§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

3.1.1 期间数据和指标	2016年		2015年5月20日(基金合同生效日)-2015年12月31日	
	南方利鑫A	南方利鑫C	南方利鑫A	南方利鑫C
本期已实现收益	58,915,091.36	12,098.42	144,658,048.35	388,082.49
本期利润	45,116,318.09	-38,522.52	150,557,186.59	723,840.50
加权平均基金份额本期利润	0.0297	-0.0015	0.0323	0.0054
本期加权平均净值利润率	2.85%	-0.15%	3.16%	0.53%
本期基金份额净值增长率	3.20%	-0.10%	3.10%	0.68%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末	
期末可供分配利润	65,557,592.10	-	60,286,740.36	684,919.48
期末可供分配基金份额利润	0.0631	-	0.0215	0.0219
期末基金资产净值	1,106,028,687.49	-	2,894,748,391.62	32,188,914.02
期末基金份额净值	1.064	-	1.031	1.031
3.1.3 累计期末指标	2016年末		2015年末	
基金份额累计净值增长率	6.40%	0.59%	3.10%	0.68%

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。

2.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.所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。

4.本报告期内,基金持有人实际持有本基金C类份额的期间为2016年1月1日--2016年1月4日。

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

南方利鑫A

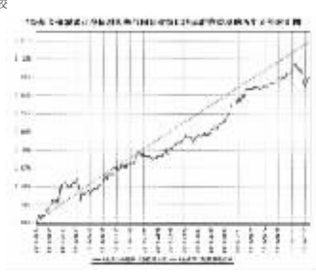
项目	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.38%	0.07%	1.12%	0.02%	-0.74%	0.05%
过去六个月	1.92%	0.07%	2.27%	0.01%	-0.35%	0.06%
过去一年	3.20%	0.07%	4.62%	0.01%	-1.42%	0.06%
自基金合同生效起至今	6.40%	0.08%	7.89%	0.01%	-1.49%	0.07%

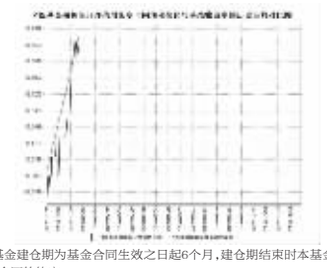
南方利鑫C

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	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
过去六个月	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
过去一年	-0.10%	0.00%	0.05%	0.00%	-0.15%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.59%	0.07%	0.73%	0.01%	-0.14%	0.06%

注:本报告期内,基金持有人实际持有本基金C类份额的期间为2016年1月1日--2016年1月4日。

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

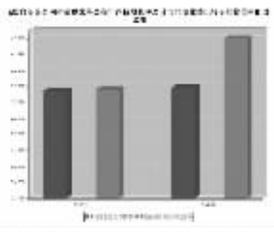


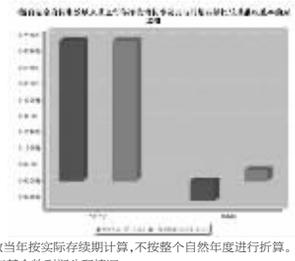


注:1、本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月,建仓期结束时本基金各项资产配置比例达到基金合同的约定。

2、本报告期内,基金持有人实际持有本基金C类份额的期间为2016年1月1日--2016年1月4日。

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:合同生效当年按实际存续期计算,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

注:过往三年本基金未有利润分配事项。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
孙鲁闽	本基金基金经理	2015年5月20日	-	13年	南开大学理学和经济学双学士、澳大利亚新南威尔士大学商学硕士,具有基金从业资格。曾任职于厦门国际银行福州分行,2003年4月加入南方基金管理有限公司,历任行业研究员、南方高增和南方隆元的基金经理助理、专户投资管理部总监助理,现任投资部副总监;2007年12月至2010年10月,担任南方基金企业年金和专户的投资经理。2010年12月至今,任南方避险基金经理;2011年6月至今,任南方保本基金经理;2015年4月至今,任南方利海基金经理;2015年5月至今,任南方利鑫基金经理;2015年5月至今,任南方丰台基金经理;2015年12月至今,任南方瑞利保本基金经理;2016年1月至今,任南方益和保本基金经理;2016年9月至今,任南方安泰养老基金经理;2016年11月至今,任南方安裕养老基金经理。
陈乐	本基金基金经理助理	2016年2月23日	-	8年	北京大学金融学硕士,具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金,历任研究部研究员、高级研究员,负责交运、有色、煤炭的行业研究;2016年2月至今,任南方避险、南方保本、南方利海、南方利鑫、南方丰台、南方益和、南方瑞利的基金经理助理;2016年10月至今,任南方安泰养老基金经理助理;2016年12月至今,任南方安裕养老基金经理助理。

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《南方利鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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。

公司每季度对旗下各组合进行投票和债券的同向交易价差专项分析,对本报告期内,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、卖出溢价率、交易占优比等因素进行了综合分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

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1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,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2016年,大类资产表现迥异。工业品在国外产能出清、国内供给侧改革、需求企稳的情况下出现了较大幅度的上涨。英国脱欧、美国大选等黑天鹅事件频发,阶段性推升了贵金属价格。美元处于加息周期中,美元相对强势,人民币经历了一定幅度的贬值。A股整体表现平稳,由于投资者结构以及政策取向发生了变化,价值股表现突出。国内债券市场收益率在流动性宽松、国外出现负利率的情况下一度触及多年历史低位,但年底在美国利率上升、货币政策转向中性、工业品价格上涨的情况下,债券收益率出现上行,所债券市场普遍存在期限错配、杠杆率高、资产流动性差等问题,因此经历了较大回调。

本基金为新股申购基金。2016年新股申购规则不断变化,对新股申购底仓的要求持续提升,本基金在保证投资组合稳健性的前提下,随着净值上升,逐步提升了股票仓位。

投资风格上,本基金的核心仓位投向低估值、高分红、具有安全边际的价值股,同时积极寻找具有竞争优势且有真正成长的白马股投资机会。2016年价值股表现较好,本基金的股票部分相对主要指数取得了一定的超额收益。

本基金在债券配置上尤其重视控制风险,以持有到期为主,主要配置短久期、高流动性、高评级的债券。由于这样的配置策略,本基金的债券部分在二季度风险事件频发、四季度债市收益率明显上升的环境下,受到的冲击较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为A级3.20%,C级-0.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们看好居民对股票的配置需求不断提升。中国居民资产配置中,房地产等实物资产占比60%,占居民总资产的比重明显偏高。2016年房地产价格大幅上涨,主要城市相继出台地产调控政策,改善型需求以及投资需求受到抑制。我们认为,在中央将房地产的主要功能定位于居住、严控系统性风险的大背景下,未来居民对于房地产的配置比重不会明显增加,金融资产的比重将会逐步提升。与美国居民资产配置相比,我国居民金融资产配置以存款、理财为主,而美国居民的金融资产则以股票、养老金、共同基金等权益类资产为主,我们预计未来居民资产配置中股票的比重有较大提升空间。

我们看好机构对股票的配置需求不断提升。首先是基本养老金入市带来资金增量。2016年12月,社保基金会评出第一批基本养老保险投资管理机构,基本养老金入市节奏加快。2015年底全国基本养老保险累计余额接近4万亿,基本养老金入市将给股市带来新增资金。其次是保险资金面临再配置压力。近年来保险行业资金运用余额持续高速增长,当前保险行业资金运用余额达到13万亿。如果考虑每年的保费收入,以及每年有一部分存量资产(存款、债券等)到期,预计2017年将有超过4万亿保险资金等待配置。除了基本养老金、保险等机构投资者,A股纳入MSCI、深港通开通等拓宽了国外机构投资者投资A股的渠道,给A股带来新增资金。

我们认为,居民和机构对股票的配置需求都在上升,而股票在大类资产中的性价比相对较高,看好2017年股市的表现。受益于机构投资者比重增加,我们认为低估值、优业绩、高分红的股票仍然是优质稀缺资产,看好这类个股的表现。同时我们发现,在过去几年经济下行的背景下,部分行业的竞争格局有了明显的改善,龙头公司的市场占有率提升,竞争优势显著,这类个股也将是我们重点关注的方向。此外,我们相对看好国家政策支持、具备效率提升潜力的国企改革、医改、军工、京津冀等板块,这些板块中的低估值个股具备长期配置价值。

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,本基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展情况,围绕重合规守底线、抓规范促发展,坚持从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,积极推动主动合规风控管理,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,本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况,不断推动完善相关制度流程的建立、健全,及时贯彻落实新的监管要求,并开展了互联网金融相关业务风险自查、信息技术专项自查等多项内控自查工作,进一步完善了公司的内控体系;对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理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,推动公司合规、内控体系的健全完善;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,持续完善投资合规风控指引流程和系统,积极配合各类新产品、新业务,重点加强内幕交易防控以及对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实,有效确保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,督促落实销售适当性管理制度;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;深入贯彻风险为本的反洗钱工作原则,优化反洗钱资源配置,加大反洗钱投入力度,购置外部专业机构黑名单数据库,积极推进符合基金业务特征的可疑交易监控模型和方法,健全创新业务洗钱风险评估机制,各项反洗钱工作进一步完善;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

本基金合同约定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;因基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,而C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本报告期本基金未有分配事项。

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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在南方利鑫灵活配置混合型证券投资基金(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21486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:南方利鑫灵活配置混合型证券投资基金
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	2,400,936.29	15,557,561.22
结算备付金	4,665,522.70	5,552,154.24
存出保证金	16,456.13	352,952.72
交易性金融资产	1,090,943,596.47	1,584,071,044.05
其中:股票投资	65,347,995.47	87,310,080.95
基金投资	-	-
债券投资	1,025,595,601.00	1,496,760,963.10
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	-	1,191,171,326.76
应收证券清算款	500,000.00	212,032,695.80
应收利息	13,970,552.58	22,328,252.85
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,112,497,064.17	3,031,065,987.64
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	4,500,000.00	100,000,000.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	433,609.30	573,206.49
应付管理人报酬	938,744.24	2,556,087.57
应付托管费	234,686.04	639,021.87
应付销售服务费	-	10,383.91
应付交易费用	67,016.41	178,821.83
应交税费	-	-
应付利息	2,342.13	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	291,978.56	171,160.33
负债合计	6,468,376.68	104,128,682.00
所有者权益:		
实收基金	1,039,483,199.92	2,839,596,226.61
未分配利润	66,545,487.57	87,341,079.03
所有者权益合计	1,106,028,687.49	2,926,937,305.64
负债和所有者权益总计	1,112,497,064.17	3,031,065,987.64

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额总额1,039,483,199.92份,其中A类基金份额总额为1,039,483,199.92份,基金份额净值为1.064元;无C类基金份额。

7.2 利润表

会计主体:南方利鑫灵活配置混合型证券投资基金
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5月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	69,356,827.61	190,440,402.59
1.利息收入	51,737,232.77	53,062,458.02
其中:存款利息收入	2,361,849.33	16,720,030.23
债券利息收入	47,403,295.43	27,876,033.56
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,972,088.01	8,466,394.23
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	29,477,981.39	102,864,860.06
其中:股票投资收益	28,651,156.28	100,939,432.02
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,469,802.18	35,682.94
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	2,296,627.29	1,889,745.10
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-13,849,394.21	6,234,896.25
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,991,007.66	28,278,188.26
减:二、费用	24,279,032.04	39,159,375.50
1. 管理人报酬	16,041,184.77	29,172,203.88
2. 托管费	4,010,296.12	7,293,051.00
3. 销售服务费	439.64	19,260.92
4. 交易费用	577,493.19	1,145,891.78
5. 利息支出	3,188,247.51	1,202,426.57
其中:卖出回购金融资产支出	3,188,247.51	1,202,426.57
6. 其他费用	461,370.81	326,541.35
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	45,077,795.57	151,281,027.09
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	45,077,795.57	151,281,027.09

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方利鑫灵活配置混合型证券投资基金
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)	2,839,596,226.61	87,341,079.03	2,926,937,305.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	45,077,795.57	45,077,795.57
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)	-1,800,113,026.69	-65,873,387.03	-1,865,986,413.72
其中:1.基金申购款	98,848.09	6,226.47	105,074.56
2.基金赎回款	-1,800,211,874.78	-65,879,613.50	-1,866,091,488.28
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)	1,039,483,199.92	66,545,487.57	1,106,028,687.49
项目	上年度可比期间 2015年5月20日(基金合同生效日)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)	5,470,700,846.28	-	5,470,700,846.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	151,281,027.09	151,281,027.09
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)	-2,631,104,619.67	-63,939,948.06	-2,695,044,567.73
其中:1.基金申购款	5,219,733,795.53	18,983,307.27	5,238,717,102.80
2.基金赎回款	-7,850,838,415.20	-82,923,255.33	-7,933,761,670.53
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)	2,839,596,226.61	87,341,079.03	2,926,937,305.64

注: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[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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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股票、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股票、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,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,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。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

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

-

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

金额单位: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5月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	36,619,665.55	10.26%	201,174,302.97	27.59%
兴业证券	31,544,987.81	8.84%	10,679,601.94	1.46%

7.4.4.1.2 权证交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	33,707.89	10.30%	33,707.89	52.19%
兴业证券	28,747.08	8.79%	2,730.95	4.23%
关联方名称	上年度可比期间 2015年5月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	179,969.40	27.50%	41,480.72	27.19%
兴业证券	9,732.29	1.49%	9,732.29	6.38%

注:

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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5月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,041,184.77	29,172,203.88
其中:支付销售机构的客户维护费	230,019.37	330,762.12

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1.00%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 1.00% / 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5月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,010,296.12	7,293,051.00

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0.25%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 0.25% / 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		
	南方利鑫A	南方利鑫C	合计
南方基金	-	439.64	439.64
合计	-	439.64	439.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年5月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方利鑫A	南方利鑫C	合计
南方基金	-	19,260.92	19,260.92
合计	-	19,260.92	19,260.92

注:自2015年4月17日(基金合同生效日)至2016年6月30日,支付基金销售机构的销售服务费按南方利鑫C类基金份额前一日基金资产净值0.50%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。其计算公式为:日销售服务费=前一日南方利鑫C类基金份额基金资产净值 X 0.50%/ 当年天数。

根据《南方基金关于继续开展旗下部分基金销售服务费优惠的公告》,自2016年7月1日起