南方安泰养老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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2017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9月22日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方安泰养老混合型证券投资基金
基金简称	南方安泰养老混合
基金主代码	003161
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月22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	2,595,481,904.10份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具,辅助投资于精选的股票,通过灵活的资产配置与严谨的风险管理,力求实现基金资产持续稳定增值,为投资者提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金在资产配置方面采用优化的恒定比例投资组合保险策略(优化CPPI)。密切关注经济运行的质量与效率,把握领先指标,预测未来走势,深入分析国家推行的财政与货币政策对未来宏观经济运行以及投资环境的影响。注重对股市趋势的研究,在股票投资限额内,精选优势行业和优势个股,控制股票市场下跌风险,分享股票市场成长收益。在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型,寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。以被动投资权证为主要策略,包括投资因持有股票而派发的权证和参与分离转债申购而获得的权证,以获取这部分权证带来的增量收益。同时,本基金将在严格控制风险的前提下,以价值分析为基础,主动进行部分权证投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%＋上证国债指数收益率×85%
风险收益特征	本基金为债券投资为主的混合型基金,属于中低风险、中低收益预期的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

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“南方安泰养老”。

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	鲍文革	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67596096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话?		400-889-8899	010-67596096
传真		0755-82763889	010-66275853
注册地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33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		张海波	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.nfund.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	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦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

3.1.1? 期间数据和指标	2016年9月22日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	17,049,859.95
本期利润	2,258,435.60
加权平均基金份额本期利润	0.0009
本期加权平均净值利润率	0.08%
本期基金份额净值增长率	0.09%
3.1.2? 期末数据和指标	2016年末
期末可供分配利润	2,423,878.42
期末可供分配基金份额利润	0.0009
期末基金资产净值	2,597,905,782.52
期末基金份额净值	1.0009
3.1.3 ?累计期末指标	2016年末?
基金份额累计净值增长率	0.09%

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。

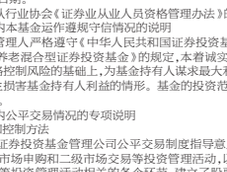
4.本基金合同生效日为2016年9月22日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

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

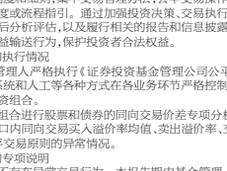
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.06%	0.06%	0.31%	0.13%	-0.25%	-0.07%
自基金合同生效起至今	0.09%	0.06%	0.37%	0.13%	-0.28%	-0.07%

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:基金合同生效日至本报告期末不满一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至报告期末基金尚未完成建仓。

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



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)管理资产规模超过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		
孙鲁园	本基金基金经理	2016年9月22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投资经理。2010年12月至今,任南方避险基金经理;2011年4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,任南方丰合基金经理;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10月18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、南方丰合、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。

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《南方安泰养老混合型证券投资基金》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股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。美国脱欧、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,而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。

仓位控制方面,本基金采用CPPI(固定比例投资组合保险)策略,以固定收益类资产的回报作为安全垫,以此作为股票仓位的约束。

本基金成立于2016年9月,至年底时仍处于建仓期。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。

由于本基金的固定收益资产配置的主要目的是积累安全垫,因此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

2016年,本基金净值增长率为0.09%。本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×15%＋上证国债指数收益率×85%,同期增长率为0.37%。

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制度流程和系统,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,购置外部专业机构制裁名单数据库,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,若本基金单位净值连续10个工作日不低于1.15元,且第10个工作日的基金可供分配利润大于零时,则本基金将以该日为基金收益分配基准日进行收益分配,但本基金两次收益分配基准日间的间隔不得低于30个工作日,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90%,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。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,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。

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(2017)第21440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	南方安泰养老混合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安泰养老混合型证券投资基金(以下简称“南方安泰养老基金”)的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表、2016年9月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间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安泰养老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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表,并做其实现公允反映; (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,以设计恰当的审计程序,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,上述南方安泰养老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、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,公允反映了南方安泰养老基金2016年12月31日的财务状况以及2016年9月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛霞　　陈麻
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	2017年3月24日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:南方安泰养老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	附注号	本期末 2016年12月31日
资?产:	?	
银行存款	7.4.7.1	802,953,008.50
结算备付金		6,359,493.17
存出保证金		40,946.15
交易性金融资产	7.4.7.2	1,738,485,308.72
其中:股票投资		103,411,922.72
基金投资		-
债券投资		1,635,073,386.00
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	43,000,000.00
应收证券清算款		2,705,472.20
应收利息	7.4.7.5	21,180,338.33
应收股利		-
应收申购款		305,194.61
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		2,615,029,761.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016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		7,700,000.00
应付证券清算款		204,118.11
应付赎回款		6,147,597.06
应付管理人报酬		2,241,320.30
应付托管费		448,264.05
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	210,030.21
应交税费		-
应付利息		215.93
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	172,433.50
负债合计		17,123,979.16
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	2,595,481,904.10
未分配利润	7.4.7.10	2,423,878.42
所有者权益合计		2,597,905,782.52
负债和所有者权益总计		2,615,029,761.68

注:1.报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.0009元,基金份额总额2,595,481,904.10份。

2.本财务报表的实际编制期间为2016年9月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体:南方安泰养老混合型证券投资基金

本报告期:2016年9月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项?目	附注号	本期 2016年9月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一.收入	?	11,608,296.71
1.利息收入		21,190,108.42
其中:存款利息收入	7.4.7.11	13,303,936.86
债券利息收入		5,878,444.35
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,007,727.21
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		5,036,683.35
其中:股票投资收益	7.4.7.12	4,969,937.68
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	34,840.67
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	31,905.00
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	-14,791,424.35
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	172,929.29
减:二.费用		9,349,861.11
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,268,721.11
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,453,744.21
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	290,245.84
5. 利息支出		170,801.78
其中:卖出回购金融资产支出		170,801.78
6. 其他费用	7.4.7.19	166,348.17
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,258,435.60
减:所得税费用		-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)		2,258,435.60

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方安泰养老混合型证券投资基金

本报告期:2016年9月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年9月22日(基金合同生效日)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)	2,661,584,983.96	-	2,661,584,983.96
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,258,435.60	2,258,435.60
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)	-66,103,079.86	165,442.82	-65,937,637.04
其中:1.基金申购款	991,310.45	-1,067.24	990,243.21
2.基金赎回款	-67,094,390.31	166,510.06	-66,927,880.25
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)	2,595,481,904.10	2,423,878.42	2,597,905,782.52

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 基金基本情况

南方安泰养老混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1706号《关于准予南方安泰养老混合型证券投资基金注册的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方安泰养老混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,659,478,816.05元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1137号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方安泰养老混合型证券投资基金基金合同》于2016年9月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,661,584,983.96份基金份额,其中认购资金利息折合2,106,167.91份基金份额。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《南方安泰养老混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、权证、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为0-30%;债券等固定收益类金融工具投资占基金资产的比例不低于70%,其中,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×15%＋上证国债指数收益率×85%。

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2017年3月24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》、《南方安泰养老混合型证券投资基金基金合同》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2016年9月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间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2016年12月31日的财务状况以及2016年9月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为2016年9月22日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间。

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股票投资和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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;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

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(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在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购