南方安心保本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:招商银行股份有限公司
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。

基金托管人招商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

基金简称	南方安心保本混合
基金主代码	202213
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月21日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,844,305,818.73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“南方安心”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化手段优化投资策略,在积极把握证券市场及相关行业发展趋势的前提下精选优势个股进行投资,力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金按照时间不变性投资组合保险(TIPP,Time Invariant Portfolio Protection)策略进行资产配置,以实现保本和增值的目标。TIPP策略设置了一条保本投资底线,该底线随着投资组合收益的增加而调整。TIPP策略改进了CPPI中保本投资底线的调整方式,每当收益率达到一定的比率并持续一段时间后,保本投资底线随比提高一定比例,以锁定一部分前期投资收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:三年期定期存款税后收益率+0.5%。
风险收益特征	本基金为保本基金,属于证券投资基金中的低风险品种。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	张燕
	联系电话	0755-82763888	0755-83199084
	电子邮箱	manager@nsouthernfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话?		400-889-8899	95555
传真		0755-82763889	0755-83195201

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
基金保证人	重庆三峡担保集团股份有限公司	重庆市渝中区中华路178号国际商务中心6楼

§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	2014年
本期已实现收益	28,390,415.53	437,199,465.88	165,646,753.69
本期利润	-10,609,974.24	340,402,100.76	335,531,001.41
加权平均基金份额本期利润	-0.0027	0.3532	0.2114
本期基金份额净值增长率	-0.30%	26.55%	22.77%
3.1.2? 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0432	0.0464	0.1485
期末基金资产净值	3,832,216,193.10	3,983,744,681.99	1,513,212,249.20
期末基金份额净值	0.997	1.000	1.224

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。

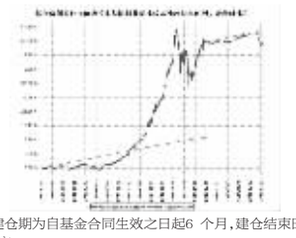
3.2 基金净值表现

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	-2.35%	0.14%	0.82%	0.01%	-3.17%	0.13%
过去六个月	-0.89%	0.12%	1.65%	0.01%	-2.54%	0.11%
过去一年	-0.30%	0.10%	3.30%	0.01%	-3.60%	0.09%
过去三年	54.80%	0.83%	11.64%	0.01%	43.16%	0.82%
自基金合同生效起至今	54.34%	0.70%	17.10%	0.01%	37.24%	0.69%

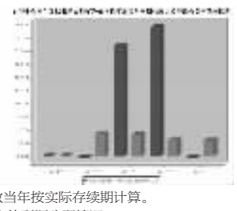
注:根据《南方安心保本混合型证券投资基金基金合同》以及《南方安心保本混合型证券投资基金保本期到期操作规则及转入下一保本期的相关规则的提示性公告》的相关规定,本基金的第一个保本期为三年,自2012年12月21日至2015年12月21日止;第二个保本期为三年,自2015年12月29日至2018年12月29日止。

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:本基金建仓期为自基金合同生效之日起6 个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	-	-	-	-	?
2015	5.0000	380,980,962.94	-	380,980,962.94	?
2014	-	-	-	-	?
合计	5.0000	380,980,962.94	-	380,980,962.94	?

§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		
刘文良	本基金基金经理	2015年12月30日	-	4年	北京大学金融学专业硕士,具有基金从业资格。2012年7月加入南方基金,历任固定收益部转债研究员、宏观研究员、信用分析师;2015年2月至2015年8月,任南方永利基金经理助理;2015年3月至今,任南方永利基金经理;2015年12月至今,任南方弘利、南方安心基金经理;2016年6月至今,任南方广利基金经理;2016年7月至今,任南方甄智混合基金经理;2016年11月至今,任南方荣发、南方卓元基金经理。
卢玉珊	本基金基金经理	2015年12月30日	-	8年	女,清华大学会计学硕士,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,负责纺织服装、商贸零售的行业研究工作;2015年2月至2015年12月,任南方成份、南方安心的基金经理助理;2015年5月至2015年12月,任南方改革机遇的基金经理助理;2015年12月至今,任南方安心基金经理。
陈键	本基金基金经理	2012年12月21日	2016年1月26日	16年	硕士学历,具有基金从业资格。2000年加入南方基金,历任行业研究员、基金经理助理、投资部执行总监。2014年12月至今,担任投资部总监。 2003年11月-2005年6月,任南方宝元基金经理;2004年3月-2005年3月,任南方现金基金经理;2006年3月-2006年3月,任南方稳配基金经理;2008年2月至2010年10月,任南方通元基金经理;2006年3月至2014年7月,任天元基金经理;2010年10月至2016年1月,任南方成份基金经理;2012年12月至2016年1月,任南方安心基金经理;2015年5月至2016年1月,任南方改革机遇基金经理。

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《南方安心保本混合型证券投资基金合同》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

安全资产方面,上半年在保本期初期控制了建仓节奏,以信用债为主,保持组合久期在较短水平,主要获取票息收益,较好地规避了4月份债券市场的调整,截止年中累积了一定的安全垫,三季度在严格控制信用风险的前提下,在一二级市场上精选性价比较高的债券加以配置,提高了组合杠杆,同时综合考虑基本面、货币政策、市场情绪等因素,择机参与了利率债行情,获取了一定的价差收益,四季度信用债以持有为主,在11、12月债券市场大幅调整过程中卖出利率债,快速降低组合久期和杠杆,但是市场调整的速度和幅度超出预期,对组合净值造成了一定的负面影响,在年底资金面紧张的时点布局了部分逆回购资产。

风险资产方面,由于年初股票市场遭遇“熔断”,使得安全垫的累积变得较为缓慢,前三季度随着净值的增长我们逐渐增加了风险资产的配置,但11月底开始债券收益率大幅上行,净值回撤较多,我们又再次下调了风险资产的仓位。随着债券市场风险的逐步释放,我们会逐步增加风险资产的配置比例。

在行业配置和个股选择策略上, 我们沿着安全低估值蓝筹和估值合理的成长股两条主线展开,对供给端调整充分、景气度持续提升的部分周期性品种也进行了配置。个股选择上注重安全边际,控制回撤风险,以相对估值水平、重估价值、价格安全锚(例如员工持股价、高管增持价、定增价格)等综合角度判断股票的安全边际,严格控制个股的下行风险。

2016年四季度经济增长数据企稳回升,补库存周期仍在持续,预计2017年一季度经济数据仍比较 平稳,需要观察房地产调控对经济的拖累作用是否会陆续显现出来,PPI同比增速继续上冲,CPI同比春节后将有所下降,此后陆续上行,中央经济工作会议定调货币政策保持稳健中性,调节好货币闸门,把防控金融风险放到更加重要的位置,着力防控资产泡沫,预计一季度流动性环境较去年四季度难有改善。综合来看,一季度的基本面和政策组合仍对债券市场形成压制,但年初配置力量相对较强,市场表现应好于去年四季度,预计整体呈现弱势震荡格局,收益率曲线较为平坦的状态下,中短端品种的性价比较高。南方安心将坚持稳健操作原则,主要获取信用债持有收益,在严格控制信用风险的前提下重点关注中短端品种,根据资金面的变化灵活调整组合的杠杆水平。

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-0.30%,业绩基准为3.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前时点股票在各大类资产相比较之下属于性价比较高的品种,养老金、保险资金的逐步入市是长期趋势, 风险偏好较低的资金占比持续提高会带来市场风格的转变。伴随着IPO加速,以及过去两年中小创大量的扩容,到现在包括业绩承诺能否兑现,以及商誉减值等都抑制风险偏好的释放,市场风格切换到企业盈利的确定性和是否超预期上,我们在股票投资上将继续秉承稳健投资、着眼中长期投资增值的思路,投资于业绩趋势稳定向上、同时估值合理的标的上,适当把握新兴产业、消费、医疗行业中可能出现的投资机会,综合运用新股申购、定增等手段提升整体收益率。

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

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;保本周期内,本基金仅采取现金分红一种收益分配方式,不进行红利再投资。转型为“南方核心竞争混合型证券投资基金”后,基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资, 投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,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;即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。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收益分配事项。

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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在备重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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21480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:南方安心保本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	16,970,481.27	231,739,230.40
结算备付金	66,533,079.34	923,681.88
存出保证金	171,410.57	386,840.03
交易性金融资产	3,202,864,282.12	43,163,992.80
其中:股票投资	118,227,423.82	36,072,992.80
基金投资	-	-
债券投资	3,084,636,858.30	7,091,000.00
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	531,176,116.77	2,663,900,000.00
应收证券清算款	-	1,065,583,509.50
应收利息	62,624,029.05	311,198.27
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,880,339,399.12	4,006,008,452.88
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	42,000,000.00	-
应付证券清算款	252,956.95	19,902,394.22
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	4,404,873.98	1,162,525.37
应付托管费	652,573.89	172,225.98
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	411,961.20	835,625.32
应交税费	-	-
应付利息	840.00	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	400,000.00	191,000.00
负债合计	48,123,206.02	22,263,770.89
所有者权益:		
实收基金	3,666,045,067.74	3,798,925,879.54
未分配利润	166,171,125.36	184,818,802.45
所有者权益合计	3,832,216,193.10	3,983,744,681.99
负债和所有者权益总计	3,880,339,399.12	4,006,008,452.88

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值0.997元,基金份额总额3,844,305,818.73份。

7.2 利润表

会计主体:南方安心保本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1月1日至2015年12月31日
一、收入	71,874,221.58	377,369,075.82
1.利息收入	143,265,596.25	58,438,134.31
其中:存款利息收入	1,266,219.09	984,163.08
债券利息收入	134,518,256.48	55,370,483.19
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	7,481,121.68	2,083,488.04
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-33,489,573.54	412,347,463.10
其中:股票投资收益	28,753,882.09	346,878,046.41
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-62,994,343.52	59,134,090.70
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	750,887.89	6,335,325.99
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-39,000,389.77	-96,797,365.12
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,098,588.64	3,380,843.53
减:二、费用	82,484,195.82	36,966,975.06
1. 管理人报酬	53,494,306.77	17,992,792.68
2. 托管费	7,925,082.46	2,665,598.91
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,055,687.59	6,519,767.79
5. 利息支出	18,513,986.92	9,308,001.29
其中:卖出回购金融资产支出	18,513,986.92	9,308,001.29
6. 其他费用	495,132.08	480,814.39
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-10,609,974.24	340,402,100.76
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-10,609,974.24	340,402,100.76

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方安心保本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)	3,798,925,879.54	184,818,802.45	3,983,744,681.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-10,609,974.24	-10,609,974.24
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)	-132,880,811.80	-8,037,702.85	-140,918,514.65
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-132,880,811.80	-8,037,702.85	-140,918,514.65
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)	3,666,045,067.74	166,171,125.36	3,832,216,193.10
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)	1,236,499,793.13	276,712,456.07	1,513,212,249.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	340,402,100.76	340,402,100.76
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)	2,562,426,086.41	-51,314,791.44	2,511,111,294.97
其中:1.基金申购款	3,413,908,175.16	165,992,578.75	3,579,900,753.91
2.基金赎回款	-851,482,088.75	-217,307,370.19	-1,068,789,458.94
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)	-	-380,980,962.94	-380,980,962.94
五、期末所有者权益(基金净值)	3,798,925,879.54	184,818,802.45	3,983,744,681.99

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

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完全一致。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 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。

7.4.2.2 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。

7.4.2.3 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。

7.4.3 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。

7.4.4 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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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。

7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.5.1.1 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1月1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	599,374,985.67	45.19%	247,503,968.29	6.13%

7.4.5.1.2 债券交易

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	116,356,600.42	9.93%	407,000,381.75	80.25%

7.4.5.1.3 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。

7.4.5.1.4 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	548,581.12	45.06%	338,904.66	94.30%
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	218,599.24	6.00%	-417.74	-0.05%

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。

7.4.5.2 关联方报酬

7.4.5.2.1 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	53,494,306.77	17,992,792.68
其中:支付销售机构的客户维护费	8,089,458.69	5,731,109.32

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1.35%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 1.35% / 当年天数。

7.4.5.2.2 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	7,925,082.46	2,665,598.91

注:支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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 0.20% / 当年天数。

7.4.5.3 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日					
	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
招商银行	61,836,615.41	-	-	-	-	-
	上年度可比期间 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
招商银行	-	-	-	-	-	-

7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

注:本报告期及上年度可比期间无各关联方投资本基金的情况。

7.4.5.5 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
招商银行	16,970,481.27	533,354.66	231,739,230.40	586,173.91

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2016年1月1日至2016年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
兴业证券	113010	江南转债	网下申购	5,500	550,000.00
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
兴业证券	-	-	-	-	-

7.4.5.7 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。

7.4.6 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

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,562	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017