

南方理财60天债券型证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
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、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中,因参考信息源不同,可能导致个别数据存在差异,基金管理人、基金托管人、基金销售机构对由此产生的差异不承担任何责任。本报告所载内容,如与法律法规、基金合同、基金招募说明书等文件存在不一致,以基金合同、基金招募说明书等文件为准。本报告所载内容,如与法律法规、基金合同、基金招募说明书等文件存在不一致,以基金合同、基金招募说明书等文件为准。

基金托管人中国工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。

基金的投资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。

本报告正文自2016年1月1日起至12月31日止。

2.1 基金基本情况

基金名称	南方理财60天债券
基金简称	南方理财60天
基金代码	002006
基金运作方式	定期开放式
基金合同生效日	2015年10月18日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,357,158,213.06元
基金合同存续期限	不定期
下属分级基金的基本情况	南方理财60天债券A 南方理财60天债券B 南方理财60天债券C
下属分级基金的基金代码	002006 002006 001041
报告期末下属分级基金资产净值	346,160,000.00元 1,010,696,000.00元 961,190,000.00元

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“南方理财60天”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,努力谋求对收益、基金资产增值和基金资产增值。
投资策略	本基金采用利率债投资策略,根据对利率的研判,合理配置利率债资产,在控制利率风险、合理配置基金资产的基础上,追求基金资产的增值。
投资范围	本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场基金等。
业绩比较基准	七天通知存款利率。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金。

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“南方理财60天”。

2.3 基金管理人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
住所	广东省深圳市福田区	北京市西城区
办公地址	深圳市福田区	北京市西城区
电子邮箱	nanfang@nanfangfund.com	custserv@icbc.com.cn
客服电话	400-889-8889	95588
传真	0755-62767389	010-61007298

2.4 信息披露方式

基金年度报告正文上网披露日期	http://www.nanfang.com.cn
基金年度报告全文披露日期	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	2016年度	2015年度	2014年度	南方理财60天债券A	南方理财60天债券B	南方理财60天债券C
本期已实现收益	11,394,401.13	39,411,401.13	23,188,401.13	56,774,401.13	1,098,401.13	-
本期利润	11,394,401.13	39,411,401.13	23,188,401.13	56,774,401.13	1,098,401.13	-
本期净收益	227,070.70	3,398,301.43	43,136,347.57	56,774,401.13	1,098,401.13	-
3.2 期末资产净值	346,160,000.00	1,010,696,000.00	961,190,000.00	600,400,000.00	40,000,000.00	-
期末基金资产净值	346,160,000.00	1,010,696,000.00	961,190,000.00	600,400,000.00	40,000,000.00	-
3.3 期末净资产	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	-
3.4 期末净资产	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	-
3.5 期末净资产	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	-

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,由于本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 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
南方理财60天债券A

阶段	基金份额净值收益率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	①-④
最近三个月	0.0278%	0.0000%	0.0278%	0.0000%	0.0278%
最近六个月	0.0545%	0.0000%	0.0545%	0.0000%	0.0545%
过去一年	0.0712%	0.0000%	0.0712%	0.0000%	0.0712%
自基金合同生效以来	0.0486%	0.0000%	0.0486%	0.0000%	0.0486%

南方理财60天债券B

阶段	基金份额净值收益率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	①-④
最近三个月	0.0278%	0.0000%	0.0278%	0.0000%	0.0278%
最近六个月	0.0545%	0.0000%	0.0545%	0.0000%	0.0545%
过去一年	0.0712%	0.0000%	0.0712%	0.0000%	0.0712%
自基金合同生效以来	0.0486%	0.0000%	0.0486%	0.0000%	0.0486%

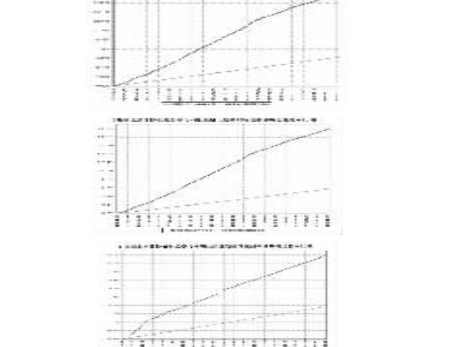
南方理财60天债券C

阶段	基金份额净值收益率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	①-④
最近三个月	0.0278%	0.0000%	0.0278%	0.0000%	0.0278%
最近六个月	0.0545%	0.0000%	0.0545%	0.0000%	0.0545%
过去一年	0.0712%	0.0000%	0.0712%	0.0000%	0.0712%
自基金合同生效以来	0.0486%	0.0000%	0.0486%	0.0000%	0.0486%

注:1、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期末集中支付。

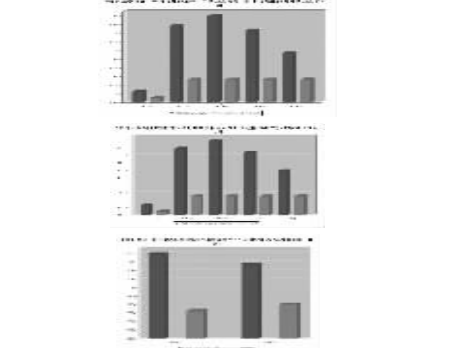
2、本基金计算份额净值收益率时所选取的运作周期,是以基金合同生效日/新增类别生效日作为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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



注:南方理财60天A类基金份额自2015年3月9日起开放申购和赎回业务。

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

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

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

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

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

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

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

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

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

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

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

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

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

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

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

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

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

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

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

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

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

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

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

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

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

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

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

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

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

年度	已实现收益形式分配收益	直接通过支付分配收益	应付利息	年度利润分配合计	备注
2016	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2015	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
2014	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配
合计	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	注:本期利润分配

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。