# 南方理财金交易型货币市场基金 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:中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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2016年12月31日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 南方理财金交易型货币市场基金 | |
| 基金简称 | 南方理财金货币ETF | |
| 基金主代码 | 000816 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式(ETF) | |
| 基金合同生效日 | 2014年12月5日 | |
| 基金管理人 | 南方基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 3,491,935,677.10份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 | |
| 上市日期 | 2015-01-06 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 理财金A | 理财金H |
| 下属分级基金的交易代码: | 000816 | 511810 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 3,245,844,334.50份 | 246,091,342.60份 |

注:1、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“南方理财金”。

2、本基金A级份额净值为1元,本基金H级份额净值为100元。

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在控制投资组合风险,保持流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将采用积极管理型的投资策略,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率(税后)。 |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。 |

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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 鲍文革 | 林菁 |
| | 联系电话 | 0755-82763888 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | manager@southernfund.com | tgcxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-889-8899 | 95599 |
| 传真 | | 0755-82763889 | 010-68121816 |

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 |

## §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12月5日(基金合同生效日)-2014年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 理财金A | 理财金H | 理财金A | 理财金H | 理财金A | 理财金H |
| 本期已实现收益 | 14,244,278.32 | 469,980,465.00 | 26,658,669.70 | 117,282,411.73 | 8,552,820.26 | 3,369,919.17 |
| 本期利润 | 14,244,278.32 | 469,980,465.00 | 26,658,669.70 | 117,282,411.73 | 8,552,820.26 | 3,369,919.17 |
| 本期净值收益率 | 2.5302% | 2.5305% | 3.4856% | 3.4883% | 0.3353% | 0.3353% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016年末 | | 2015年末 | | 2014年末 | |
| 期末基金资产净值 | 3,245,844,334.50 | 24,609,134,260.34 | 425,907,584.92 | 12,256,984,660.07 | 2,559,564,991.70 | 1,008,500,919.17 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 100.00 | 1.0000 | 100.00 | 1.0000 | 100.00 |

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 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

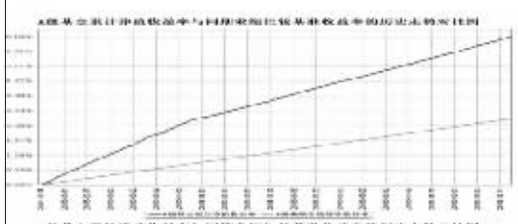
理财金A

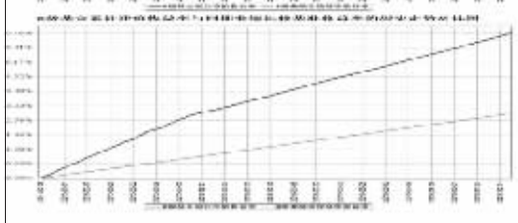
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.6486% | 0.0021% | 0.3456% | 0.0000% | 0.3030% | 0.0021% |
| 过去六个月 | 1.2767% | 0.0017% | 0.6924% | 0.0000% | 0.5843% | 0.0017% |
| 过去一年 | 2.5302% | 0.0016% | 1.3819% | 0.0000% | 1.1483% | 0.0016% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.4598% | 0.0043% | 2.8832% | 0.0000% | 3.5766% | 0.0043% |

理财金H

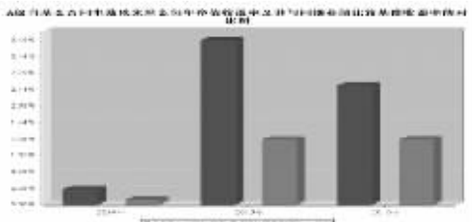
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.6479% | 0.0021% | 0.3456% | 0.0000% | 0.3023% | 0.0021% |
| 过去六个月 | 1.2758% | 0.0017% | 0.6924% | 0.0000% | 0.5834% | 0.0017% |
| 过去一年 | 2.5305% | 0.0016% | 1.3819% | 0.0000% | 1.1486% | 0.0016% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.4628% | 0.0043% | 2.8832% | 0.0000% | 3.5796% | 0.0043% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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





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

单位:人民币元

| 理财金A | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 年度 | 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动 | 年度利润分配合计 | 备注 |
| 2016 | 14,244,278.32 | - | - | 14,244,278.32 | ? |
| 2015 | 26,658,669.70 | - | - | 26,658,669.70 | ? |
| 2014 | 8,552,820.26 | - | - | 8,552,820.26 | ? |
| 合计 | 49,455,768.28 | - | - | 49,455,768.28 | ? |

单位:人民币元

| 理财金H | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 年度 | 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动 | 年度利润分配合计 | 备注 |
| 2016 | 469,980,465.00 | - | - | 469,980,465.00 | ? |
| 2015 | 117,282,411.73 | - | - | 117,282,411.73 | ? |
| 2014 | 3,369,919.17 | - | - | 3,369,919.17 | ? |
| 合计 | 590,632,795.90 | - | - | 590,632,795.90 | ? |

## §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 | | |
| 蔡奕奕 | 本基金基金经理 | 2016年8月26日 | - | 10年 | 女,中南大学管理科学与工程专业硕士,具有基金从业资格。曾先后就职于万家基金、银河基金、融通基金,历任交易员、研究员、基金经理助理;2011年10月至2015年3月,任融通易支付货币基金经理;2012年3月至2015年3月,任融通内季添利债券基金经理;2012年11月至2015年3月,任融通岁岁添利债券基金经理;2014年10月至2015年3月,任融通月月添利定开债券基金经理。2015年4月加入南方基金;2016年8月至今,任南方新金宝、南方理财金、南方日添益基金经理;2016年11月至今,任南方天天利基金经理。 |
| 刘莹 | 本基金基金经理 | 2016年4月29日 | - | 7年 | 女,中国科学院管理科学与工程专业硕士,具有基金从业资格。曾任泰康资产管理有限公司固定收益交易员、信诚人寿保险有限公司固定收益研究员。2014年8月加入南方基金,任固定收益部研究员;2015年2月至2016年4月,任南方理财60天基金经理助理;2016年4月至今,任南方理财14天、南方收益宝、南方理财金基金经理;2016年7月至今,任南方日添益货币基金经理。 |
| 夏赫曦 | 本基金基金经理 | 2014年12月5日 | 2016年11月17日 | 11年 | 香港科技大学理学硕士,具有基金从业资格。2005年5月加入南方基金,曾担任金融工程研究员、固定收益研究员、风险控制员等职务,现任固定收益部副总监、社保理事会委托产品投资决策委员会委员、固定收益投资决策委员会委员。2008年6月至2012年7月,任固定收益部投资经理,负责社保、专户及年金组合的投资管理;2012年7月至2015年1月,任南方润元基金经理;2014年7月至2016年11月,任南方薪金宝基金经理;2014年12月至2016年11月,任南方理财金基金经理;2012年8月至今,任南方理财14天基金经理;2012年10月至今,任南方理财60天基金经理;2013年1月至今,任南方收益宝基金经理;2014年7月至今,任南方现金增利、南方现金通基金经理;2016年2月至今,任南方日添益货币基金经理;2016年10月至今,任南方天天利基金经理。 |

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《南方理财金交易型货币市场基金基金合同》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,以及投权、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

海外方面,整体看全球经济数据在年底有所好转,货币政策逐步转向,主要经济体的债市收益率出现上行。其中美国经济复苏相对稳健,美联储加息符合预期。欧央行继续延长QE,仍有宽松姿态但态度不明确。日元贬值,通胀回升,利率有上行压力。国内方面,经济全年弱势企稳,GDP增速稳定在6.7%,工业增加值增速稳定在6.2左右。CPI保持温和走势,PPI全年由负转正。

政策方面,货币政策稳健中性,全年没有降息,仅有一次降准,央行主要采用公开市场操作、MLF等提供流动性。8月央行重启14天逆回购,标志着金融去杠杆提速,货币政策转向实质性偏紧,短端资金面中枢上升且波动加大。

市场层面,前三季度,在长期经济增长预期和资金配置压力的共同作用下走出了一轮结构性牛市行情,表现为信用利差和期限利差大幅压缩。其中十年期利率债收益率在4月、8月出现一定的调整后再次下行。但进入四季度,全球通胀预期上升且受制于金融去杠杆和人民币贬值压力,国内货币政策转向实质性偏紧,债市出现剧烈调整。特别是货币市场利率出现飙升,短期债券利率上涨明显,对组合的流动性管理提出了较高要求。组合操作上,前三季度我们基本把握了市场节奏,为投资者提供了较高收益。第四季度,我们提前预判了资金面可能出现的紧张状况,提前降低了组合久期,提高了基金流动性,因此较为成功地应对了本次市场波动,严格控制住了组合风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期A级基金净值收益率为2.5302%,同期业绩比较基准收益率为1.3819%。H级基金净值收益率为2.5305%,同期业绩比较基准收益率为1.3819%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计2017年国内经济整体缓中趋稳,明年经济的主要拖累来自于房地产。房贷对信贷数据的影响也将显现,地产整体对经济的托底作用减弱。另一方面,明年经济主要依靠基建进行对冲。但由于财政支出增速及赤字约束制约了基建增速所能达到的高度,因此基建能否完全对冲地产、汽车的下滑仍有疑问。通胀方面,农业供给侧改革是明年工作重点,粮食价格可能企稳回升。全年来看,明年PPI进一步向CPI传导,但食品价格仍弱于季节性。预计全年CPI均值2.4%,较16年有所上升。

政策层面,由于美国处于加息周期之中,美元指数还有上行空间,将对人民币形成进一步的贬值压力并制约国内货币政策。除了人民币贬值压力外,金融去杠杆、控制资产泡沫、通胀水平抬升也共同制约明年货币政策的空间,预计当前实质性偏紧的货币政策取向将延续。但另一方面,经济实际增速仍有下行压力,能否加息取决于通胀水平。

我们预计,短期内流动性将持续紧张,影响债券市场企稳。国内外的不确定性都在上升。中期来看,由于房地产收缩政策及财政支出的乏力,明年实际经济增速仍有一定的下行压力。不过考虑到PPI大幅转正和CPI温和通胀,明年的名义增速将小幅上行。建议密切观察经济基本面情况,相对看好明年中后期债市的配置机会。货币市场利率目前仍处于较高位置,具备一定的配置价值,但阶段性时点上仍有大幅波动的可能。此外,仍需要严防信用风险,加强持仓债券的跟踪和梳理。综合来看,我们将继续保持组合的良好的流动性,为广大客户提供稳健可靠的投资收益。

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

根据本基金合同约定,本基金场外份额根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,且每日进行支付,支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式;本基金场内份额根据每日基金收益情况,以每百份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,计入投资人收益账户,投资人收益账户里的累计未付收益和其持有的基金份额一起参加当日的收益分配。收益账户高于100元以上的整百元收益于每个工作日转为基金份额支付到投资人的证券账户。

本报告期内应分配收益484,224,743.32元,实际分配收益484,224,743.32元。

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

在托管南方理财金交易型货币市场基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《南方理财金交易型货币市场基金基金合同》、《南方理财金交易型货币市场基金托管协议》的约定,对南方理财金交易型货币市场基金管理人—南方基金管理有限公司2016年1月1日至2016年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,除2016年3月23日、5月25日、10月31日南方理财金交易型货币市场基金投资现金、国债、中央银行票据、政策性金融债占基金资产净值的比例低于5%,不符合《货币市场基金监督管理办法》及基金合同规定,上述情况是由于当日流动性资产大量到期以及基金规模变动较大等原因导致无法及时补足比例,南方理财金交易型货币市场基金均已及时调整投资比例至符合相关法规及基金合同规定,未给持有人造成损失;2016年11月7日至11月18日因中债资信评级公司下调部分短期融资券评级,导致南方理财金交易型货币市场基金有8笔超级短期融资券的评级被动低于AA+(041660045_16、011698385_16、011698622_16、041661018_16、011620001_16、011698183_16、011698099_16、011699451_16),该2笔短期融资券同期已有中国证监会认可的评级机构给予了AAA评级,且截止本报告披露日已处理完毕,未给持有人造成损失。南方基金管理有限公司在南方理财金交易型货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各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

本托管人认为,南方基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的南方理财金交易型货币市场基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

5.6 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21453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:南方理财金交易型货币市场基金

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 | 7,855,373,999.39 | 5,315,248,424.98 |
| 结算备付金 | 20,011,828.59 | 17,134,148.84 |
| 存出保证金 | 41,520.03 | 19,495.02 |
| 交易性金融资产 | 12,819,549,625.55 | 4,967,197,007.60 |
| 其中:股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 12,819,549,625.55 | 4,967,197,007.60 |
| 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 | 7,391,454,028.17 | 2,360,257,540.38 |
| 应收证券清算款 | 602,091,794.97 | - |
| 应收利息 | 82,071,327.41 | 50,080,163.08 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 200.00 | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | 3,406.67 |
| 资产总计 | 28,770,594,324.11 | 12,709,940,186.57 |
| 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 | 902,100,000.00 | 21,499,872.25 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | 499.25 |
| 应付管理人报酬 | 5,942,372.22 | 2,440,231.53 |
| 应付托管费 | 1,980,790.73 | 813,410.52 |
| 应付销售服务费 | 4,951,976.90 | 2,033,526.29 |
| 应付交易费用 | 110,304.11 | 59,026.00 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 66,285.31 | 1,374.99 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 464,000.00 | 200,000.75 |
| 负债合计 | 915,615,729.27 | 27,047,941.58 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 27,854,978,594.84 | 12,682,892,244.99 |
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 27,854,978,594.84 | 12,682,892,244.99 |
| 负债和所有者权益总计 | 28,770,594,324.11 | 12,709,940,186.57 |

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额总额3,491,935,677.10份,其中A类基金份额总额3,245,844,334.50份,基金份额净值1.0000元,H类基金份额总额246,091,342.60份,基金份额净值100.00元。

7.2 利润表

会计主体:南方理财金交易型货币市场基金

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 | 620,317,200.97 | 182,424,683.82 |
| 1.利息收入 | 578,912,624.47 | 166,808,915.68 |
| 其中:存款利息收入 | 238,484,799.16 | 91,715,619.65 |
| 债券利息收入 | 302,504,400.52 | 57,522,831.98 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 37,923,424.79 | 17,570,464.05 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | 41,368,938.54 | 15,615,723.69 |
| 其中:股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 41,368,938.54 | 15,615,723.69 |
| 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) | - | - |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 35,637.96 | 44.45 |
| 减:二、费用 | 136,092,457.65 | 38,483,602.39 |
| 1. 管理人报酬 | 58,295,369.00 | 15,551,965.81 |
| 2. 托管费 | 19,431,789.62 | 5,183,988.60 |
| 3. 销售服务费 | 48,579,474.18 | 12,959,971.46 |
| 4. 交易费用 | - | - |
| 5. 利息支出 | 9,030,228.29 | 4,155,690.69 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 9,030,228.29 | 4,155,690.69 |
| 6. 其他费用 | 755,596.56 | 631,985.83 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 484,224,743.32 | 143,941,081.43 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | 484,224,743.32 | 143,941,081.43 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方理财金交易型货币市场基金

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) | 12,682,892,244.99 | - | 12,682,892,244.99 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 484,224,743.32 | 484,224,743.32 |
| 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) | 15,172,086,349.85 | - | 15,172,086,349.85 |
| 其中:1.基金申购款 | 81,706,965,869.28 | - | 81,706,965,869.28 |
| 2.基金赎回款 | -66,534,879,519.43 | - | -66,534,879,519.43 |
| 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) | - | -484,224,743.32 | -484,224,743.32 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 27,854,978,594.84 | - | 27,854,978,594.84 |
| 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) | 3,568,065,910.87 | - | 3,568,065,910.87 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 143,941,081.43 | 143,941,081.43 |
| 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) | 9,114,826,334.12 | - | 9,114,826,334.12 |
| 其中:1.基金申购款 | 26,794,476,276.27 | - | 26,794,476,276.27 |
| 2.基金赎回款 | -17,679,649,942.15 | - | -17,679,649,942.15 |
| 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) | - | -143,941,081.43 | -143,941,081.43 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 12,682,892,244.99 | - | 12,682,892,244.99 |

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

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 |
| 中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”) | 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 | 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

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交易。

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 | 58,295,369.00 | 15,551,965.81 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 10,601,411.55 | 1,015,053.30 |

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0.30%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 0.30% / 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 | 19,431,789.62 | 5,183,988.60 |

注:支付基金托管人 中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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 0.10% / 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 | | |
| | 理财金A | 理财金H | 合计 |
| 南方基金 | 594,003.59 | 26,475,374.33 | 27,069,377.92 |
| 中国农业银行 | 180,118.26 | - | 180,118.26 |
| 华泰证券 | 4,833.50 | 7,649,862.89 | 7,654,696.39 |
| 兴业证券 | - | 106,363.22 | 106,363.22 |
| 合计 | 778,955.35 | 34,231,600.44 | 35,010,555.79 |
| 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 | | |
| | 理财金A | 理财金H | 合计 |
| 南方基金 | 628,024.44 | 6,662,973.65 | 7,290,998.09 |
| 中国农业银行 | 638,736.72 | - | 638,736.72 |
| 华泰证券 | 7,763.32 | 1,958,158.16 | 1,965,921.48 |
| 兴业证券 | - | 50,996.97 | 50,996.97 |
| 合计 | 1,274,524.48 | 8,672,118.78 | 9,946,643.26 |

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,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类基金份额和H类基金份额约定的销售服务费年费率均为0.25%。销售服务费的计算公式为:日销售服务费=前一日对应类别基金资产净值 X约定年费率 / 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

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 |
| 中国农业银行 | 534,407,745.76 | 233,487,998.36 | - | - | 3,292,141,000.00 | 211,604.20 |
| | 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