

南方薪金宝货币市场基金

2016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:中信银行股份有限公司
送出日期:2017年3月30日

§ 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。

基金托管人中信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01月01日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方薪金宝货币
基金代码	000607
基金运作方式	契约型开放式
上市交易场所	深圳证券交易所
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金的份额	3,079,360,471.04份
基金份额持有人数	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“南方薪金宝”。

2.2 基金产品说明

投资目标	在货币市场基金的基础上，保持流动性的情况下，力争实现超越同业平均水平的收益。
投资策略	本基金主要投资于货币市场工具，包括回购协议、短期债券、现金类资产以及具有较高流动性的金融衍生品。本基金将根据对资金池的流动性需求，通过定期调整资产配置比例，降低基金净值波动风险并满足流动性的情况下，提高基金收益率。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为同期七天银行存款利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其预期平均收益和预期风险低于股票型基金，高于货币型基金。

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	中信银行股份有限公司
法定代表人	姚文超	万群
信息披露负责人	王海峰 0755-82023009	4000000000
电子邮箱	fanji@sfam.com	fanji@ccb.com
客户服务电话	95533-0000	95533
传真	0755-82023009	0755-82020024

2.4 信息披露方式

披露基金年度报告的管理人互联网网址	http://www.sffund.com
基金年度报告备查地点	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

项目	2016年	2015年	2014年1月1日至2014年12月31日
本期初累计收益	98,452,577.01	67,616,360.03	11,630,511.26
本期末累计收益	98,452,577.01	67,616,360.03	11,630,511.26
本期的利润收益	2,076% ¹	3,707% ²	2,071% ³
3.1.2 利润数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末未分配利润	3,079,360,471.04	2,477,727,833.18	1,014,296,136.64
期末未分配利润/净值	1,0000	1,0000	1,0000

注：本期已实现收益指本基金本期利息收入、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已实现价值变动收益，由于货币市场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。

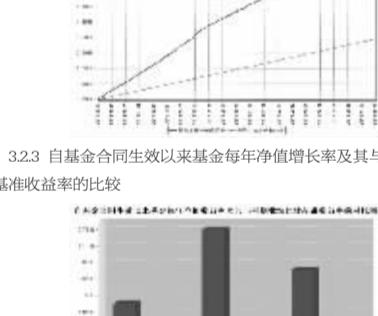
3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	预期收益率	预期收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.0006%	0.0031%	0.360%	0.0000%	0.260%	0.0004%
过去六个月	1.400%	0.0001%	1.00%	0.0114%	1.360%	0.0005%
过去一年	2.076%	0.0000%	1.210%	0.0000%	1.476%	0.0006%
自基金合同生效至今	8.042%	0.0005%	3.620%	0.0000%	5.442%	0.0006%

注：本基金收益分配原则按日结转份额。

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



注：基金合同生效当年按照实际存续期计算，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

单位:人民币元

年度	已实现利润	直接通过应付赎回款账户支付的金额	应付利润	年内变动	年内利润	合计	备注
2016	98,452,577.01	-	-	-	98,452,577.01		
2015	67,616,360.03	-	-	-	67,616,360.03		
2014	11,630,511.26	-	-	-	11,630,511.26		
合计	177,708,430.00	-	-	-	177,708,430.00		

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及其基金经理情况

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。

南方基金总部落在深圳，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。

4.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	自基金合同成立之日起至今任本基金基金经理	说明
姚文超	本基金基金经理	2016年8月26日	10年
徐超	本基金基金经理	2016年7月25日	11年

4.3 管理人对报告期内基金运作总体评价

报告期内，南方基金管理有限公司严格按照《基金法》及其他法律法规、基金合同和托管协议的规定，对南方薪金宝货币市场基金2016年度基金的投资运作，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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守《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规定，对南方薪金宝货币市场基金2016年度基金的投资运作，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，不存在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，南方基金管理有限公司在南方薪金宝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确定、基金费用的收取及开支等方面，不存在损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本基金年度报告真实性的确认意见

本托管人复核了南方基金管理有限公司编制的南方薪金宝货币市场基金2016年度报告，认为该报告真实、准确、完整地反映了本基金2016年度的经营成果。

5.4 托管人对年度报告中财务信息真实性的说明

本托管人复核了南方基金管理有限公司编制的南方薪金宝货币市场基金2016年度报告，认为该报告真实、准确、完整地反映了本基金2016年度的经营成果。

5.5 托管人对年度报告中重要事项的意见

本托管人复核了南方基金管理有限公司编制的南方薪金宝货币市场基金2016年度报告，认为该报告真实、准确、完整地反映了本基金2016年度的经营成果。

5.6 托管人对年度报告中财务信息的复核意见

本托管人复核了南方基金管理有限公司编制的南方薪金宝货币市场基金2016年度报告，认为该报告真实、准确、完整地反映了本基金2016年度的经营成果。

5.7 托管人对年度报告中其他重要事项的意见

本托管人复核了南方基金管理有限公司编制的南方薪金宝货币市场基金2016年度报告，认为该报告真实、准确、完整地反映了本基金2016年度的经营成果。

5.8 托管人对年度报告中财务信息的复核意见

本托管人复核了南方基金管理有限公司编制的南方薪金宝货币市场基金2016年度报告，认为该报告真实、准确、完整地反映了本基金2016年度的经营成果。

5.9 托管人对年度报告中其他重要事项的意见

本托管人复核了南方基金管理有限公司编制的南方薪金宝货币市场基金2016年度报告，认为该报告真实、准确、完整地反映了本基金2016年度的经营成果。

5.10 托管人对年度报告中其他重要事项的复核意见

本托管人复核了南方基金管理有限公司编制的南方薪金宝货币市场基金2016年度报告，认为该报告真实、准确、完整地反映了本基金2016年度的经营成果。

5.11 托管人对年度报告中其他重要事项的复核意见

本托管人复核了南方基金管理有限公司编制的南方薪金宝货币市场基金2016年度报告，认为该报告真实、准确、完整地反映了本基金2016年度的经营成果。

5.12 托管人对年度报告中其他重要事项的复核意见

本托管人复核了南方基金管理有限公司编制的南方薪金宝货币市场基金2016年度报告，认为该报告真实、准确、完整地反映了本基金2016年度的经营成果。

5.13 托管人对年度报告中其他重要事项的复核意见

本托管人复核了南方基金管理有限公司编制的南方薪金宝货币市场基金2016年度报告，认为该报告真实、准确、完整地反映了本基金2016年度的经营成果。

5.14 托管人对年度报告中其他重要事项的复核意见