

南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 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

送出日期：2016 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月25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2015年01月01日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
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.....	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	51

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	51
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
8.11 投资组合报告附注.....	51
§9 基金份额持有人信息.....	52
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	53
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	54
§10 开放式基金份额变动.....	54
§11 重大事件揭示.....	54
11.1 基金份额持有人大会决议.....	54
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
11.4 基金投资策略的改变.....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
11.8 其他重大事件.....	56
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金（LOF）	
基金简称	南方永利 1 年定期开放债券（LOF）	
场内简称	南方永利	
基金主代码	160130	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2013 年 4 月 25 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	254,695,301.53 份	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2013-06-06	
下属分级基金的基金简称:	南方永利 1 年定期开放债券（LOF）A	南方永利 1 年定期开放债券（LOF）C
下属分级基金的交易代码:	160130	160132
报告期末下属分级基金的份额总额	245,300,952.07 份	9,394,349.46 份

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“南方永利”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，在非开放期期间原则上组合久期与初始非开放期适当匹配的基础上，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+1.2%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	010-66105798
注册地址	深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	深圳市福田区福华一路 六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	吴万善	姜建清

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.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
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

§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	2015 年		2014 年		2013 年 4 月 25 日(基金合同生效日)- 2013 年 12 月 31 日	
	南方永利 1 年定期开放债券 (LOF) A	南方永利 1 年定期开放债券 (LOF) C	南方永利 1 年定期开放债券 (LOF) A	南方永利 1 年定期开放债券 (LOF) C	南方永利 1 年定期开放债券 (LOF) A	南方永利 1 年定期开放债券 (LOF) C
本期已实现收益	68,224,256.44	-127,911.19	38,594,773.13	290,527.24	194,686,948.41	-
本期利润	20,153,778.61	-1,066,8	231,616,975.47	602,378.23	45,045,158.22	-

		35.32				
加权平均基金份额本期利润	0.0743	-0.1649	0.1210	0.3926	0.0069	-
本期加权平均净值利润率	6.53%	-15.88%	51.47%	36.70%	0.00%	-
本期基金份额净值增长率	1.47%	1.10%	42.97%	40.19%	0.70%	-
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末		2014 年末		2013 年末	
期末可供分配利润	-	-	46,333.9	222,824.6	45,045,	-
	12,215.3	510,454	54.28	0	158.22	
	24.80	.41				
期末可供分配基金份额利润	-0.0498	-0.0543	0.1460	0.1437	0.0069	-
期末基金资产净值	240,426,	9,186,4	427,625,	2,090,751	6,581,0	-
	459.28	87.53	069.95	.61	23,978.	
					80	
期末基金份额净值	0.980	0.978	1.348	1.348	1.007	-
3.1.3 累计期末指标	2015 年末		2014 年末		2013 年末	
基金份额累计净值增长率	46.08%	41.74%	43.97%	40.19%	0.70%	-

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. 本基金自2014年4月28日起增加C类收费模式，原有收费模式称为A类。

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

南方永利1年定期开放债券（LOF）A

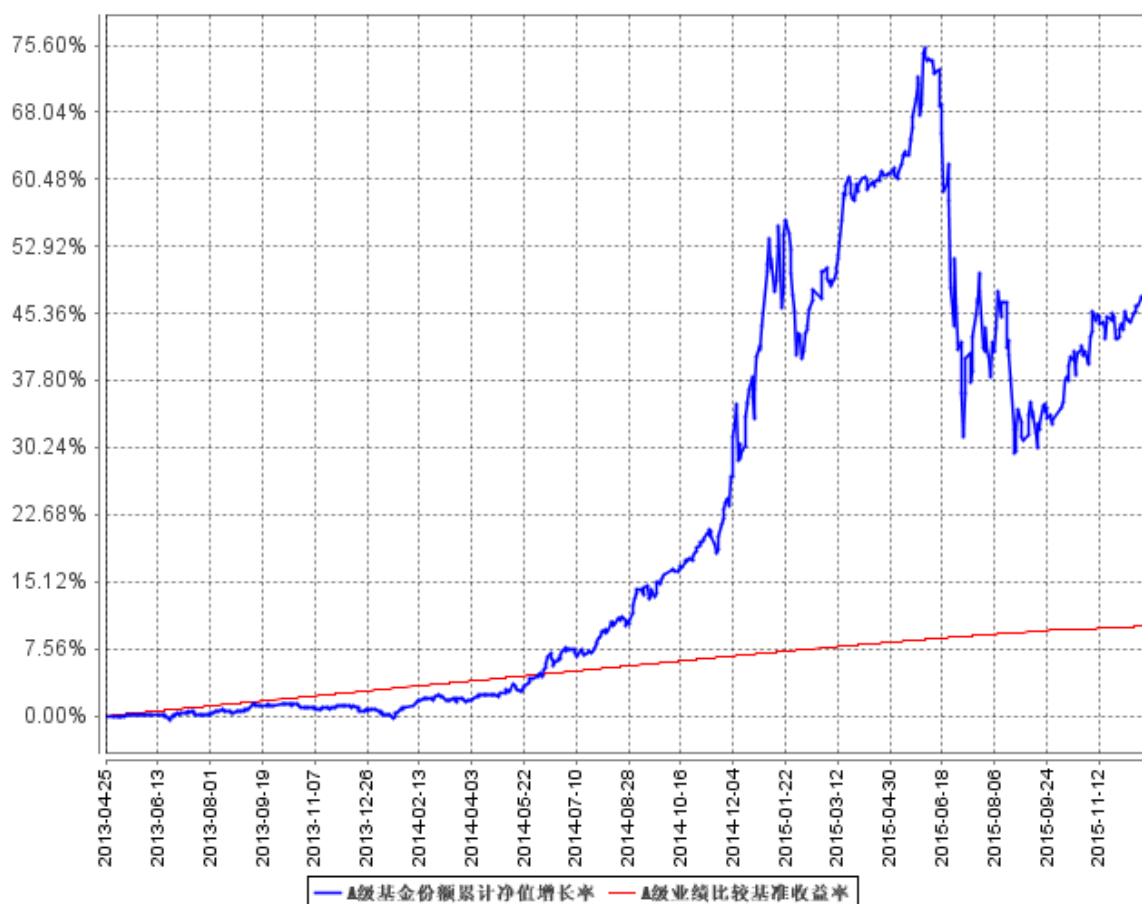
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.62%	0.74%	0.71%	0.00%	8.91%	0.74%
过去六个月	-3.66%	1.42%	1.50%	0.01%	-5.16%	1.41%
过去一年	1.47%	1.48%	3.36%	0.01%	-1.89%	1.47%
自基金合同生效起至今	46.08%	0.99%	10.52%	0.01%	35.56%	0.98%

南方永利1年定期开放债券（LOF）C

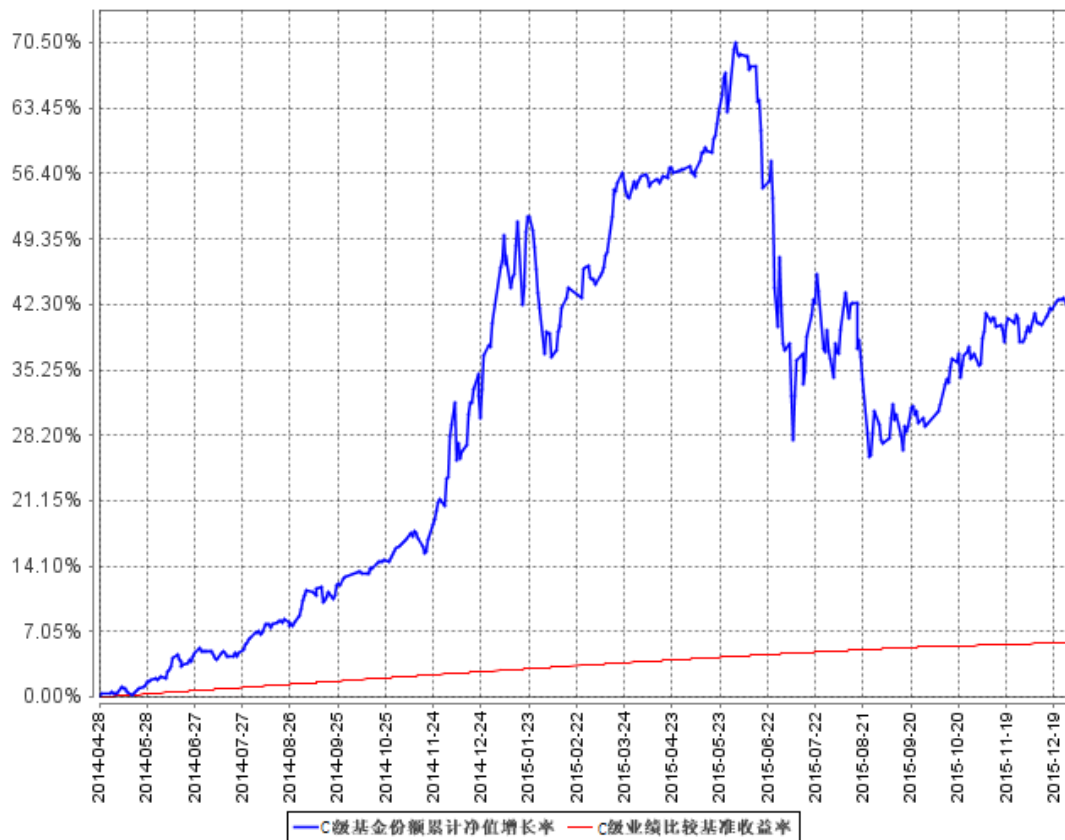
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	9.52%	0.73%	0.71%	0.00%	8.81%	0.73%
过去六个月	-3.77%	1.42%	1.50%	0.01%	-5.27%	1.41%
过去一年	1.10%	1.48%	3.36%	0.01%	-2.26%	1.47%
自基金合同生效起至今	41.74%	1.24%	6.22%	0.01%	35.52%	1.23%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

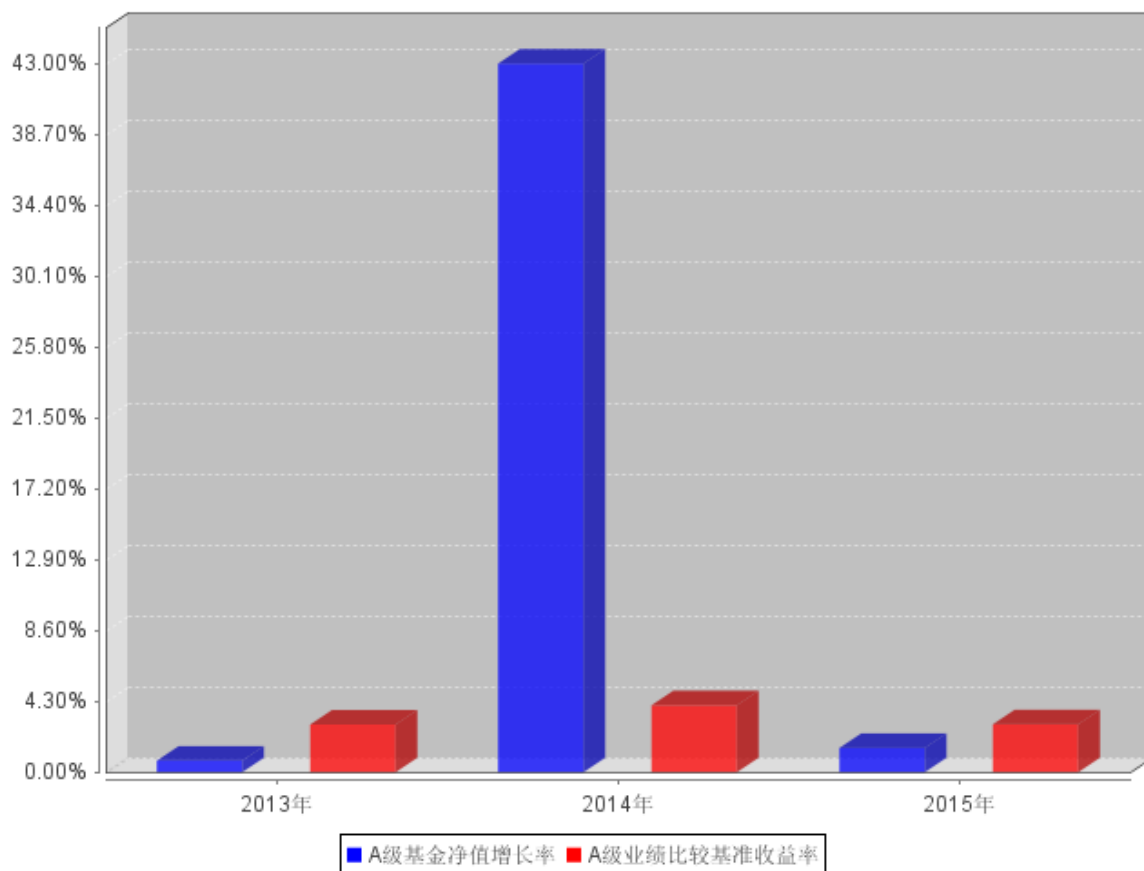


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

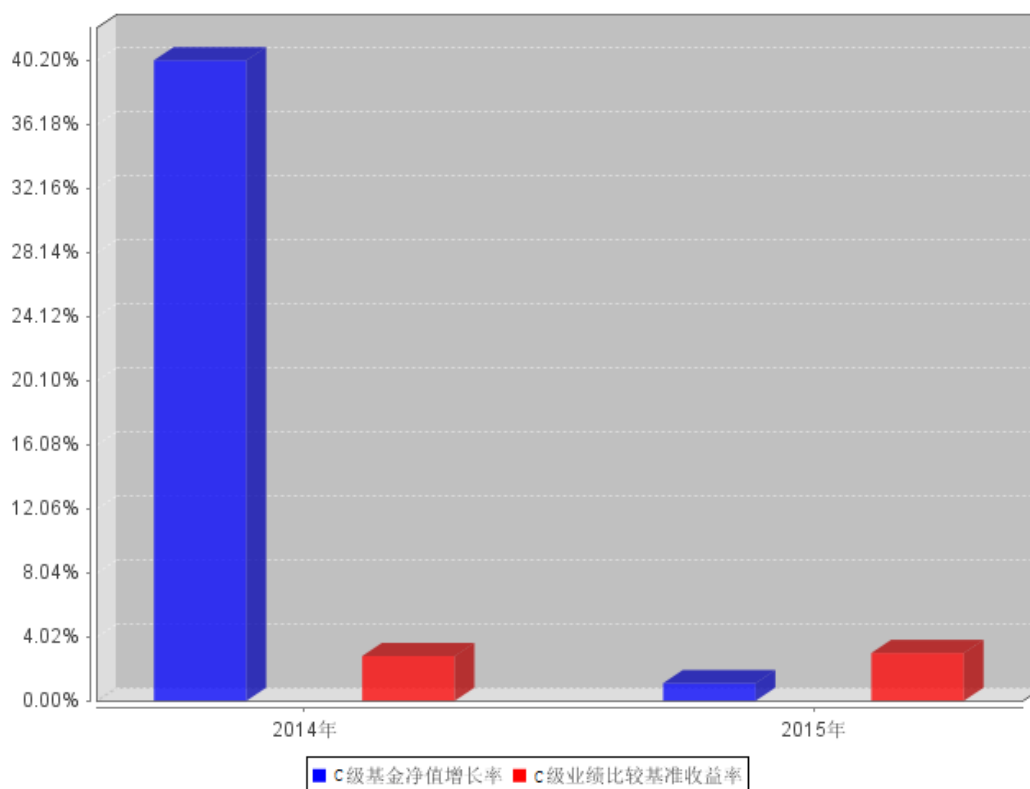


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级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对比图



C级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对比图



注：1. 基金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。

2. 本基金自2014年4月28日起增加C类收费模式，原有收费模式称为A类。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

南方永利1年定期开放债券（LOF）A					
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
2015	3.9500	89,092,903.87	28,146,916.81	117,239,820.68	
2014	0.7100	98,789,692.32	23,169,998.78	121,959,691.10	
2013	-	-	-	-	
合计	4.6600	187,882,596.19	51,316,915.59	239,199,511.78	

单位：人民币元

南方永利1年定期开放债券（LOF）C					
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
2015	3.9300	1,163,483.78	324,482.15	1,487,965.93	
2014	0.5000	76,713.21	795.51	77,508.72	
2013	-	-	-	-	

合计	4.4300	1,240,196.99	325,277.66	1,565,474.65	
----	--------	--------------	------------	--------------	--

§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5,000亿元，旗下管理85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		
韩亚庆	本基金基金经理、固定收益部总监	2013年4月25日	-	15年	经济学硕士，具有基金从业资格。2000年开始从事固定收益类证券承销、研究与投资管理，曾任职于国家开发银行资金局、全国社会保障基金理事会投资部。2008年加入南方基金，历任固定收益部副总监、执行总监，2014年12月至今，担任固定收益部总监；2008年11月至今，任南方现金基金经理；2010年11月至今，任南方广利基金经理；2013年4月至今，任南方永利基金经理；2015年11月至今，任南方荣光基金经理。
刘文良	本基金基金经理	2015年8月20日	-	3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，具有2年半固定收益研究经验，半年基金经理助理经验，历任固定收益部转债研究员、宏观研究员、信用分析师、南方永利基金经理助理；2015年8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。
--	--	--	--	--	-------

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合规守信情况的说明

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《南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合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。

公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合同单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

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 9 次，其中 5 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，2 次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致，2 次是由于投资组合的投资策略需要，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

2015 年经济下行压力大，货币政策放松，央行多次降准、降息，上半年长端利率债收益率震荡，收益率曲线以陡峭化下行为主，下半年短端资金利率稳定性显著提高，股灾后大量资金涌入债券市场，推动收益率曲线平坦化下行，全年 10 年国债和 10 年国开收益率分别下降 80BP、96BP，信用利差显著压缩。权益市场全年大幅波动，上半年杠杆驱动快速上涨，三季度经历股灾冲击，四季度低位反弹，可转债走势与权益市场一致，牛市过程中受益供需失衡、估值抬升表现较好，股灾中表现差，四季度有所反弹，全年中证转债指数下跌 26.5%。纯债方面，南方永利前三季度以信用债持有为主，获取收益率下行阶段的收益，四季度考虑到经济下行阶段信用风险上升，市场信用风险偏高下降，择机卖出了信用资质较弱的个券，降低组合的信用风险，同时少量参与了利率债的波段行情；权益方面，牛市阶段通过高仓位获取了较高的收益，但 6 月中旬市场开始调整后，对市场在短期内经历大幅下跌未做好仓位方面的准备，对融资降杠杆的系统性风险认识不足，基金未能及时止盈，过早的补仓转债和维持了偏高的股票仓位，导致基金净值出现大幅快速下跌，四季度积极参与权益市场反弹，净值有所回升，全年实现正收益，总结下来股灾前后的操作对基金净值伤害较大，在此深表歉意，将深刻反省，未来力争降低组合净值波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金 A 级净值增长率为 1.47%，本报告期基金 C 级净值增长率为 1.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年底的中央经济工作会议确定供给侧改革和需求侧托底的基调，2016 年经济仍有下行压力，通胀维持较低水平，货币政策维持宽松格局，虽然不会大幅放水，但资金利率稳定性明显上升，上述因素有利于债券市场，同时我们也注意到目前债券绝对收益率已经降至历史较低水平，货币政策边际上进一步宽松的阻力上升，未来利率下行的斜率将明显减小，波动加大，需要关注稳增长刺激政策、大宗商品价格、美联储加息、汇率波动等潜在风险因素。经济下行阶段信用事件明显增多，信用风险上升，预计市场的信用风险偏好将进一步下降。权益市场方面，汇率波动、经济增长悲观预期、一级供给加大、再融资放开、股东减持等因素拖累市场，下行支撑来自宽松

的货币环境和政策托底，总体来看市场的不确定性加大，需要降低回报预期，审慎操作，可转债整体估值依然偏贵，中期来看一级供给加速将带来估值中枢下行压力，现阶段重点关注个券的交易性机会，待一级供给充分释放，估值回归合理，个券选择增加，可以择机增加配置。南方永利基金将继续以经济、政策和市场三者关系为研究分析重点，在最新市场环境下通过大类资产选择和配置，在控制基金下行风险的基础上，积极为投资者累积回报。下一阶段，纯债方面适当调整信用债持仓结构，以中短期限品种为主，严格控制信用风险，耐心等待提高组合久期的机会，酌情参与长端利率债的阶段性行情；权益方面以精选可转债个券为主，把握交易性机会，耐心等待一级供给充分释放后的配置机会。

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，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、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，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，本基金管理人开展了基金管理公司合规风险全面自查、分级基金折算自查等多项内控自查工作，制定或修订了合规手册、公平交易操作指引、股票池管理制度等内部制度，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；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，督促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；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；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；基金合同生效满 6 个月后，若基金在每季度最后一个交易日收盘后某类基金份额类别每 10 份基金份额可分配利润金额高于 0.05 元(含)，则基金须在 15 个工作日之内进行该基金份额类别的收益分配，各基金份额类别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 80%；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，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。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；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。由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的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，基金合同生效满 6 个月后，若基金在每季度最后一个交易日收盘后某类基金份额类别每 10 份基金份额可分配利润金额高于 0.05 元(含)，则基金须在 15 个工作日之内进行该基金份额类别的收益分配，各基金份额类别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 80%。

本报告期内第一季度末满足分红条件，本基金于 2015 年 4 月 17 日进行了收益分配（A 类每 10 份基金份额派发红利 1.63 元，C 类每 10 份基金份额派发红利 1.62 元）；本报告期内第二季度末满足分红条件，本基金于 2015 年 7 月 16 日进行了收益分配（A 类每 10 份基金份额派发红利 1.15 元、C 类每 10 份基金份额派发红利 1.16 元）；本报告期内第三季度末和四季度末未满足分红条件，未安排分红。本报告期内 2015 年 1 月 20 日已分配数（A 类每 10 份基金份额派发红利 1.17 元，C 类每 10 份基金份额派发红利 1.15 元）为以往年度收益分配。

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

本报告期内，本基金托管人在对南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金（LOF）的管理人——南方基金管理有限公司在南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金（LOF）对基金份额持有人进行了 3 次利润分配，分配金额为 118,727,786.61 元。

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

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金（LOF）2015 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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(2016)第 21234 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	南方永利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人:	
引言段	我们审计了后附的南方永利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)(以下简称“南方永利1年定期开放基金”)的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年度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	<p>一、管理层对财务报表的责任</p> <p>编制和公允列报财务报表是南方永利1年定期开放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:</p> <p>(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,并使其实现公允反映;</p> <p>(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。</p>	
注册会计师的责任段	<p>二、注册会计师的责任</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	
审计意见段	<p>三、审计意见</p> <p>我们认为,上述南方永利1年定期开放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,公允反映了南方永利1年定期开放基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>	
注册会计师的姓名	薛竞	陈熹
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	2016年3月25日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方永利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,910,703.13	2,026,209.85
结算备付金		10,366,433.91	21,598,351.86
存出保证金		23,791.01	109,642.38
交易性金融资产	7.4.7.2	283,038,322.50	786,715,668.40
其中：股票投资		28,008,874.47	36,579,571.73
基金投资		-	-
债券投资		255,029,448.03	750,136,096.67
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	-	-
应收证券清算款		30,656,949.48	1,271,263.97
应收利息	7.4.7.5	3,979,917.24	10,999,665.51
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		329,976,117.27	822,720,801.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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		80,000,000.00	390,799,635.00
应付证券清算款		-	1,528,665.80
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		147,710.49	236,957.49
应付托管费		42,202.99	67,702.15
应付销售服务费		3,106.92	658.92
应付交易费用	7.4.7.7	15,150.06	58,167.57
应交税费		-	-

应付利息		-	22,193.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	155,000.00	291,000.00
负债合计		80,363,170.46	393,004,980.41
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	254,695,301.53	318,835,106.44
未分配利润	7.4.7.10	-5,082,354.72	110,880,715.12
所有者权益合计		249,612,946.81	429,715,821.56
负债和所有者权益总计		329,976,117.27	822,720,801.97

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额总额254,695,301.53份，其中A类基金份额总额为245,300,952.07份，基金份额净值0.980元；C类基金份额总额为9,394,349.46份，基金份额净值0.978元。

7.2 利润表

会计主体：南方永利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
一、收入		26,083,624.13	279,758,328.64
1.利息收入		17,114,164.44	148,898,654.70
其中：存款利息收入	7.4.7.11	613,943.79	54,800,324.06
债券利息收入		16,475,233.25	71,349,920.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		24,987.40	22,748,410.62
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		57,975,999.96	-62,524,379.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	19,542,459.19	-24,268,441.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	37,898,684.86	-38,461,833.22
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	534,855.91	205,895.82
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-49,009,401.96	193,334,053.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,861.69	50,000.00
减：二、费用		6,996,680.84	47,538,974.94
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,216,439.39	16,899,599.66
2. 托管费	7.4.10.2.2	633,268.36	4,828,456.98
3. 销售服务费		26,435.81	4,438.87
4. 交易费用	7.4.7.19	272,717.84	806,603.56
5. 利息支出		3,380,685.40	24,477,456.81
其中：卖出回购金融资产支出		3,380,685.40	24,477,456.81
6. 其他费用	7.4.7.20	467,134.04	522,419.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,086,943.29	232,219,353.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,086,943.29	232,219,353.70

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方永利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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）	318,835,106.44	110,880,715.12	429,715,821.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,086,943.29	19,086,943.29
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）	-64,139,804.91	-16,322,226.52	-80,462,031.43
其中：1. 基金申购款	101,508,271.88	21,418,770.62	122,927,042.50
2. 基金赎回款	-165,648,076.79	-37,740,997.14	-203,389,073.93
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）	-	-118,727,786.61	-118,727,786.61
五、期末所有者权益	254,695,301.53	-5,082,354.72	249,612,946.81

项目	上年度可比期间		
	2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
（基金净值）			
一、期初所有者权益（基金净值）	6,535,978,820.58	45,045,158.22	6,581,023,978.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	232,219,353.70	232,219,353.70
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）	-6,217,143,714.14	-44,346,596.98	-6,261,490,311.12
其中：1. 基金申购款	24,662,795.93	337,784.01	25,000,579.94
2. 基金赎回款	-6,241,806,510.07	-44,684,380.99	-6,286,490,891.06
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）	-	-122,037,199.82	-122,037,199.82
五、期末所有者权益（基金净值）	318,835,106.44	110,880,715.12	429,715,821.56

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

基金管理人负责人

徐超

主管会计工作负责人

徐超

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方永利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)(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[2013]124号《关于核准南方永利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)募集的批复》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《南方永利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型、定期开放式,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6,531,624,309.74元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第206号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方永利1年定期开放债券型证券

投资基金(LOF)基金合同》于 2013 年 4 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,535,978,820.58 份，其中认购资金利息折合 4,354,510.84 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金(LOF)基金合同》和《南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定，本基金自基金合同生效后，每年开放一次申购和赎回。封闭期内，投资者不能申购和赎回基金份额，但可通过深圳证券交易所转让基金份额。开放期内，投资人可进行基金份额的申购和赎回，也可通过深圳证券交易所转让基金份额。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2013]183 号文审核同意，本基金 17,785,193.00 份基金份额于 2013 年 6 月 6 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《关于南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金(LOF)增加收费模式并修改基金合同的公告》和《南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金(LOF)招募说明书》，自 2014 年 4 月 28 日起，本基金根据申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取前端申购费用的称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，并分别计算基金份额净值。A 类基金份额通过场外和场内两种方式销售，场内份额在交易所上市交易；C 类基金份额通过场外方式销售，不在交易所上市交易。未上市交易的份额托管在场外，其中 A 类基金份额可跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通，C 类基金份额不能进行跨系统转托管至场内。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金对固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，其中对除国债和央行票据外的信用类固定收益金融工具的投资比例合计不低于基金固定收益类金融工具的 80%。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可参与一级市场新股申购或增发新股，并持有因参与新股申购或增发所形成的股票以及因可转债转股所形成的股票、持有股票所派发的权证、可分

离债券产生的权证，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种，但上述资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%。在开放期，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在非开放期，本基金不受上述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为：一年期定期存款税后收益率+1.2%。

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 2016 年 3 月 25 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》、《南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金(LOF)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 2015 年度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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度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。

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几乎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。

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，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方

法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低

于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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,股权的股息、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,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
活期存款	1,910,703.13	2,026,209.85
定期存款	-	-
其中:存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计:	1,910,703.13	2,026,209.85

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	34,580,218.12	28,008,874.47	-6,571,343.65
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	212,736,448.03	-1,053,893.53
	银行间市场	42,293,000.00	2,308,098.36
	合计	255,029,448.03	1,254,204.83
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	288,355,461.32	283,038,322.50	-5,317,138.82
项目	上年度末 2014年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	33,363,430.49	36,579,571.73	3,216,141.24
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	619,930,202.18	658,910,096.67
	银行间市场	89,729,772.59	91,226,000.00
	合计	709,659,974.77	750,136,096.67
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	743,023,405.26	786,715,668.40	43,692,263.14

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	510.80	1,911.75
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	4,664.90	9,719.30
应收债券利息	3,974,730.84	10,987,985.16
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	10.70	49.30
合计	3,979,917.24	10,999,665.51

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	10,756.06	50,006.03
银行间市场应付交易费用	4,394.00	8,161.54
合计	15,150.06	58,167.57

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	155,000.00	291,000.00
合计	155,000.00	291,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

南方永利 1 年定期开放债券 (LOF) A		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	317,284,210.75	317,284,210.75
本期申购	93,029,112.08	93,029,112.08
本期赎回 (以“-”号填列)	-165,012,370.76	-165,012,370.76
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	245,300,952.07	245,300,952.07

金额单位：人民币元

南方永利 1 年定期开放债券 (LOF) C		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,550,895.69	1,550,895.69
本期申购	8,479,159.80	8,479,159.80
本期赎回 (以“-”号填列)	-635,706.03	-635,706.03

- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	9,394,349.46	9,394,349.46

注:

1. 根据《南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的相关规定, 本基金的封闭期为自基金合同生效之日 (含) 起或自每一开放期结束之日次日 (含) 起一年的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日期一年。下一封闭期为首个开放期结束之日次日起一年, 以此类推。根据《南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 开放申购、赎回业务的公告》, 本基金自 2015 年 5 月 11 日 (含) 至 2015 年 5 月 22 日 (含) 止进入开放期, 接受投资者的申购和赎回申请。

2. 截至 2015 年 12 月 31 日止, 本基金于深圳证券交易所上市的 A 类基金份额为 8,909,027.00 份 (2014 年 12 月 31 日: 11,689,134.00 份), 托管在场外未上市交易的基金份额为 245,786,274.53 份, 其中 A 类基金份额 236,391,925.07 份, C 类基金份额 9,394,349.46 份 (2014 年 12 月 31 日: A 类基金份额 305,595,076.75 份, C 类基金份额 1,550,895.69 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统, 可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回; 未上市的基金份额登记在注册登记系统, 按基金份额净值申购或赎回。A 类基金份额可跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通, C 类基金份额不能进行跨系统转托管至场内。

7.4.7.10 未分配利润

单位: 人民币元

南方永利 1 年定期开放债券 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	46,333,954.28	64,006,904.92	110,340,859.20
本期利润	68,224,256.44	-48,070,477.83	20,153,778.61
本期基金份额交易产生的变动数	-9,533,714.84	-8,595,595.08	-18,129,309.92
其中: 基金申购款	9,434,564.40	10,033,271.66	19,467,836.06
基金赎回款	-18,968,279.24	-18,628,866.74	-37,597,145.98
本期已分配利润	-117,239,820.68	-	-117,239,820.68
本期末	-12,215,324.80	7,340,832.01	-4,874,492.79

单位: 人民币元

南方永利 1 年定期开放债券 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	222,824.60	317,031.32	539,855.92

本期利润	-127,911.19	-938,924.13	-1,066,835.32
本期基金份额交易产生的变动数	882,598.11	924,485.29	1,807,083.40
其中：基金申购款	953,180.50	997,754.06	1,950,934.56
基金赎回款	-70,582.39	-73,268.77	-143,851.16
本期已分配利润	-1,487,965.93	-	-1,487,965.93
本期末	-510,454.41	302,592.48	-207,861.93

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	53,810.13	442,197.06
定期存款利息收入	318,750.00	53,222,979.40
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	238,879.63	1,128,072.26
其他	2,504.03	7,075.34
合计	613,943.79	54,800,324.06

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	134,957,245.44	397,525,514.38
减：卖出股票成本总额	115,414,786.25	421,793,956.37
买卖股票差价收入	19,542,459.19	-24,268,441.99

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	900,339,605.40	6,695,715,829.93
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	849,147,315.32	6,619,162,678.75

减：应收利息总额	13,293,605.22	115,014,984.40
买卖债券差价收入	37,898,684.86	-38,461,833.22

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
股票投资产生的股利收益	534,855.91	205,895.82
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	534,855.91	205,895.82

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
1. 交易性金融资产	-49,009,401.96	193,334,053.33
——股票投资	-9,787,484.89	1,849,088.19
——债券投资	-39,221,917.07	191,484,965.14
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-49,009,401.96	193,334,053.33

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
基金赎回费收入	10.81	-
可交换债利息	2,850.88	-
债券分销手续费	-	50,000.00
基金合同生效前利息收入	-	-
合计	2,861.69	50,000.00

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
交易所市场交易费用	270,767.84	795,928.51
银行间市场交易费用	1,950.00	10,675.05
合计	272,717.84	806,603.56

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
审计费用	55,000.00	82,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
债券托管账户维护费	27,650.00	45,000.00
银行费用	24,484.04	34,819.06
其他	-	600.00
合计	467,134.04	522,419.06

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	24,740,203.16	18.33%	145,582,659.03	36.62%

7.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	16,261.47	14.19%	1,714.33	15.94%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	92,767.50	30.47%	11,419.69	22.84%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年 12月31日	2014年1月1日至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,216,439.39	16,899,599.66
其中：支付销售机构的客户维护费	778,632.65	8,264,454.92

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0.70%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 × 0.70% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年 12月31日	2014年1月1日至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	633,268.36	4,828,456.98

注：支付基金托管人中国工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 × 0.20% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 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		
	南方永利1年定期 开放债券（LOF）A	南方永利1年定期 开放债券（LOF）C	合计
中国工商银行	-	5,803.81	5,803.81
南方基金	-	2,101.69	2,101.69
兴业证券	-	101.32	101.32
合计	-	8,006.82	8,006.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方永利1年定期 开放债券（LOF）A	南方永利1年定期 开放债券（LOF）C	合计
中国工商银行	-	-	-
南方基金	-	114.59	114.59
兴业证券	-	-	-
合计	-	114.59	114.59

注：自2014年4月28日起，支付销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率计提，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类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日C类基金份额基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

7.4.10.3 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 2015年1月1日至2015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
中国工商银行	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中国工商银行	-	29,955,470.82	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中国工商银行	1,910,703.13	53,810.13	2,026,209.85	442,197.06

注：本基金的活期存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 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 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	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	110025	国金转债	新债承销	6,800	680,000.00

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

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。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

南方永利1年定期开放债券（LOF）A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		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	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2015年 7月16日	2015年 7月17日	2015年 7月16日	1.1500	20,289,120.23	7,050,521.45	27,339,641.68	
2	2015年 4月17日	2015年 4月20日	2015年 4月17日	1.6300	39,938,593.73	12,839,332.73	52,777,926.46	
3	2015年 1月20日	2015年 1月21日	2015年 1月20日	1.1700	28,865,189.92	8,257,062.63	37,122,252.55	
合计	-	-	-	3.9500	89,092,903.87	28,146,916.81	117,239,820.68	

南方永利1年定期开放债券（LOF）C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		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	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2015年 7月16日	-	2015年 7月16日	1.1600	803,816.54	254,249.21	1,058,065.75	
2	2015年 4月17日	-	2015年 4月17日	1.6200	183,684.33	67,862.84	251,547.17	
3	2015年 1月20日	-	2015年 1月20日	1.1500	175,982.91	2,370.10	178,353.01	
合计	-	-	-	3.9300	1,163,483.78	324,482.15	1,487,965.93	

注：本基金的基金管理人于资产负债表日后，报告批准报出日前宣告的利润分配情况，请参见附注7.4.8.2 资产负债表日后事项。

7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
002065	东华软件	2015年 12月22日	重大事项	25.10	-	-	94,391	2,901,287.42	2,369,214.10	-
600219	南山铝业	2015年 9月29日	重要事项	6.58	2016年 1月25日	7.00	235,902	2,410,918.44	1,552,235.16	-

			未公告							
--	--	--	-----	--	--	--	--	--	--	--

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 80,000,000.00 元，于 2016 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要为债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行；定期存款存放在具有基金托管资格的中信银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 100.10% (2014 年 12 月 31 日：174.57%)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可定期要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放申赎期间每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金

资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2015年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有80,000,000.00元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,910,703.13	-	-	-	1,910,703.13
结算备付金	10,366,433.91	-	-	-	10,366,433.91
存出保证金	23,791.01	-	-	-	23,791.01
交易性金融资产	64,885,899.23	143,628,857.60	46,514,691.20	28,008,874.47	283,038,322.50
应收证券清算款	-	-	-	-30,656,949.48	30,656,949.48
应收利息	-	-	-	3,979,917.24	3,979,917.24
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	77,186,827.28	143,628,857.60	46,514,691.20	62,645,741.19	329,976,117.27
负债					
卖出回购金融资产款	80,000,000.00	-	-	-	80,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	147,710.49	147,710.49

应付托管费	-	-	-	42,202.99	42,202.99
应付销售服务费	-	-	-	3,106.92	3,106.92
应付交易费用	-	-	-	15,150.06	15,150.06
其他负债	-	-	-	155,000.00	155,000.00
负债总计	80,000,000.00	-	-	363,170.46	80,363,170.46
利率敏感度缺口	-2,813,172.72	143,628,857.60	46,514,691.20	62,282,570.73	249,612,946.81
上年度末 2014年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,026,209.85	-	-	-	2,026,209.85
结算备付金	21,598,351.86	-	-	-	21,598,351.86
存出保证金	109,642.38	-	-	-	109,642.38
交易性金融资产	83,244,754.00	479,077,271.82	187,814,070.85	36,579,571.73	786,715,668.40
应收证券清算款	-	-	-	1,271,263.97	1,271,263.97
应收利息	-	-	-	10,999,665.51	10,999,665.51
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	106,978,958.09	479,077,271.82	187,814,070.85	48,850,501.21	822,720,801.97
负债					
卖出回购金融资产款	390,799,635.00	-	-	-	390,799,635.00
应付证券清算款	-	-	-	1,528,665.80	1,528,665.80
应付管理人报酬	-	-	-	236,957.49	236,957.49
应付托管费	-	-	-	67,702.15	67,702.15
应付销售服务费	-	-	-	658.92	658.92
应付交易费用	-	-	-	58,167.57	58,167.57
应付利息	-	-	-	22,193.48	22,193.48
其他负债	-	-	-	291,000.00	291,000.00
负债总计	390,799,635.00	-	-	2,205,345.41	393,004,980.41
利率敏感度缺口	-283,820,676.91	479,077,271.82	187,814,070.85	46,645,155.80	429,715,821.56

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年12月31日）	上年度末（2014年12月31日）
	市场利率下降25个基点	1,600,000.00	3,750,000.00
市场利率上升25个基点	-1,580,000.00	-3,720,000.00	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	28,008,874.47	11.22	36,579,571.73	8.51
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	28,008,874.47	11.22	36,579,571.73	8.51

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 8.51% (2013 年 12 月 31 日：0.23%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2013 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为58,375,888.44元，属于第二层次的余额为224,662,434.06元，无属于第三层次的余额(2014年12月31日：第一层次693,892,873.40元，第二层次92,822,795.00元，无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于2015年3月16日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	28,008,874.47	8.49
	其中：股票	28,008,874.47	8.49
2	固定收益投资	255,029,448.03	77.29
	其中：债券	255,029,448.03	77.29
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	12,277,137.04	3.72
7	其他各项资产	34,660,657.73	10.50
8	合计	329,976,117.27	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	361,449.46	0.14
C	制造业	10,299,677.05	4.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,760,079.50	0.71
E	建筑业	530,531.68	0.21
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,614,159.60	1.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,374,643.50	1.75
J	金融业	5,453,985.16	2.18

K	房地产业	575,948.52	0.23
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	38,400.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	28,008,874.47	11.22

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002521	齐峰新材	395,863	4,948,287.50	1.98
2	000089	深圳机场	494,161	4,032,353.76	1.62
3	600109	国金证券	199,802	3,220,808.24	1.29
4	002065	东华软件	94,391	2,369,214.10	0.95
5	600016	民生银行	214,703	2,069,736.92	0.83
6	600037	歌华有线	93,124	2,004,959.72	0.80
7	601139	深圳燃气	174,545	1,588,359.50	0.64
8	600219	南山铝业	235,902	1,552,235.16	0.62
9	002391	长青股份	82,638	1,472,609.16	0.59
10	002318	久立特材	80,080	1,225,224.00	0.49
11	600703	三安光电	35,288	856,792.64	0.34
12	600026	中海发展	62,966	581,805.84	0.23
13	600067	冠城大通	65,898	575,948.52	0.23
14	600820	隧道股份	49,862	530,531.68	0.21
15	600028	中国石化	72,845	361,311.20	0.14
16	601985	中国核电	18,000	171,720.00	0.07
17	601318	中国平安	4,540	163,440.00	0.07
18	300458	全志科技	500	59,500.00	0.02
19	603789	星光农机	1,000	44,020.00	0.02
20	300433	蓝思科技	500	41,690.00	0.02

21	002776	柏堡龙	500	38,400.00	0.02
22	300444	双杰电气	1,000	32,780.00	0.01
23	002763	汇洁股份	500	22,575.00	0.01
24	300460	惠伦晶体	500	17,995.00	0.01
25	002752	昇兴股份	500	17,500.00	0.01
26	002787	华源包装	500	8,185.00	0.00
27	601929	吉视传媒	76	469.68	0.00
28	600875	东方电气	18	245.34	0.00
29	603993	洛阳钼业	31	138.26	0.00
30	000425	徐工机械	9	38.25	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	19,718,498.66	4.59
2	600028	中国石化	11,724,568.32	2.73
3	600219	南山铝业	11,103,682.52	2.58
4	2521	齐峰新材	9,298,761.96	2.16
5	2065	东华软件	8,931,140.44	2.08
6	603993	洛阳钼业	7,806,243.32	1.82
7	425	徐工机械	7,602,081.75	1.77
8	89	深圳机场	6,839,464.14	1.59
9	600016	民生银行	5,749,535.96	1.34
10	600875	东方电气	5,501,034.10	1.28
11	601929	吉视传媒	4,866,992.17	1.13
12	600026	中海发展	4,259,422.44	0.99
13	601139	深圳燃气	3,667,470.12	0.85
14	600037	歌华有线	2,983,692.96	0.69
15	2391	长青股份	2,186,633.57	0.51
16	601988	中国银行	2,130,295.20	0.50
17	600067	冠城大通	2,037,701.25	0.47
18	601985	中国核电	61,020.00	0.01
19	600958	东方证券	40,120.00	0.01
20	603898	好莱客	19,570.00	0.00

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600109	国金证券	23,680,647.65	5.51
2	601318	中国平安	20,685,720.83	4.81
3	600028	中国石化	12,199,949.67	2.84
4	002065	东华软件	11,863,653.04	2.76
5	603993	洛阳钼业	9,875,045.90	2.30
6	600219	南山铝业	9,269,744.09	2.16
7	600820	隧道股份	8,692,260.29	2.02
8	000425	徐工机械	8,346,334.30	1.94
9	600875	东方电气	5,547,167.37	1.29
10	601929	吉视传媒	5,186,176.10	1.21
11	600026	中海发展	3,979,297.76	0.93
12	600016	民生银行	3,868,253.34	0.90
13	601988	中国银行	2,376,503.32	0.55
14	601139	深圳燃气	1,618,015.47	0.38
15	600703	三安光电	1,548,174.18	0.36
16	002318	久立特材	1,419,747.48	0.33
17	600067	冠城大通	1,413,664.31	0.33
18	002521	齐峰新材	1,368,726.76	0.32
19	000089	深圳机场	971,177.08	0.23
20	002391	长青股份	514,549.50	0.12

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	116,631,573.88
卖出股票收入（成交）总额	134,957,245.44

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,154,525.60	2.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	205,293,459.20	82.24
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,293,000.00	4.12
7	可转债（可交换债）	34,288,463.23	13.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	255,029,448.03	102.17

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128009	歌尔转债	170,509	23,951,399.23	9.60
2	124321	13岳城投	199,900	20,951,519.00	8.39
3	124307	13安经开	199,970	20,552,916.60	8.23
4	132001	14宝钢EB	130,620	20,214,751.20	8.10
5	136057	15华发01	200,000	20,100,000.00	8.05

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,791.01
2	应收证券清算款	30,656,949.48
3	应收股利	-
4	应收利息	3,979,917.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,660,657.73

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128009	歌尔转债	23,951,399.23	9.60
2	110031	航信转债	9,360,165.60	3.75
3	110030	格力转债	976,898.40	0.39

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002065	东华软件	2,369,214.10	0.95	重大事项
2	600219	南山铝业	1,552,235.16	0.62	重大事项

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方永利1年定期开放债券(LOF) A	3,278	74,832.51	42,506,828.87	17.33%	202,794,123.20	82.67%
南方永利1年定期开放债券(LOF) C	258	36,412.21	0.00	0.00%	9,394,349.46	100.00%
合计	3,536	72,029.21	42,506,828.87	16.69%	212,188,472.66	83.31%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

9.2 期末上市基金前十名持有人

南方永利1年定期开放债券（LOF）A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	黄国柱	888,584.00	9.97%
2	廖斯颖	717,400.00	8.05%
3	徐正仪	500,000.00	5.61%
4	刘敏华	300,000.00	3.37%
5	肖唯物	234,300.00	2.63%
6	杨凯	200,460.00	2.25%
7	鲁玺	197,000.00	2.21%
8	刘凤琴	180,300.00	2.02%
9	陈萌萌	164,300.00	1.84%
10	雷毅	160,800.00	1.80%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方永利 1 年定期开放债券（LOF）A	435,871.67	0.1777%
	南方永利 1 年定期开放债券（LOF）C	29,732.41	0.3165%
	合计	465,604.08	0.1828%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方永利 1 年定期开放债券（LOF）A	0
	南方永利 1 年定期开放债券（LOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方永利 1 年定期开放债券（LOF）A	0
	南方永利 1 年定期开放债券（LOF）C	0~10
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方永利 1 年定期开放债券（LOF）A	南方永利 1 年定期开放债券（LOF）C
基金合同生效日（2013 年 4 月 25 日）基金份额总额	6,535,978,820.58	-

本报告期期初基金份额总额	317,284,210.75	1,550,895.69
本报告期基金总申购份额	93,029,112.08	8,479,159.80
减:本报告期基金总赎回份额	165,012,370.76	635,706.03
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以"- "填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	245,300,952.07	9,394,349.46

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第十四次会议审议通过,并向中国基金业协会报备,基金管理人于 2015 年 5 月 29 日发布公告,聘任常克川、李海鹏为公司副总经理。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所,本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 55,000.00 元,该审计机构已提供审计服务的连续年限为 3 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	110,217,042.28	81.67%	98,358.32	85.81%	-
华泰证券	1	24,740,203.16	18.33%	16,261.47	14.19%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	848,314,980.26	86.36%	28,651,500,000.00	99.01%	-	-
华泰证券	133,996,784.95	13.64%	286,100,000.00	0.99%	-	-

注：交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年12月29日
2	南方基金关于旗下部分基金增加利得基金为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年12月23日
3	南方基金关于旗下部分基金增加济安财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年12月17日
4	南方基金关于旗下部分基金增加大泰金石为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年12月11日
5	南方基金关于旗下部分基金增加凯石财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年12月8日
6	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年12月4日
7	南方基金关于旗下部分基金增加富济财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年11月24日
8	关于电子直销业务调整通联支付申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年11月23日
9	南方基金关于旗下部分基金增加陆金所资管为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年11月9日
10	南方基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购最低金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年11月9日
11	南方基金关于旗下部分基金增加泉州银行为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年11月4日
12	南方基金关于旗下部分基金增加盈米财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年10月16日

13	南方基金关于旗下部分基金增加中信期货为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年9月23日
14	南方基金管理有限公司关于公司旗下开放式基金变更代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年9月12日
15	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年8月26日
16	关于南方永利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年8月20日
17	关于注意防范冒用南方基金名义进行的非法证券活动的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年8月7日
18	南方基金关于旗下部分基金增加中信建投期货为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年8月3日
19	南方基金关于旗下部分基金增加天风证券为代销机构及开通定投和转换业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年7月31日
20	南方基金关于旗下部分基金增加江南农村商业银行、第一创业、大连银行、青岛银行和包商银行为代销机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年7月30日
21	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年7月21日
22	南方基金关于旗下部分基金增加汇付金融为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年7月20日
23	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年7月14日
24	南方永利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年7月13日
25	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年7月10日
26	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年7月9日
27	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年6月19日

28	南方基金关于电子直销平台开通货币基金快速转购业务并实行0费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年6月8日
29	南方基金关于旗下部分基金增加宜信普泽为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年6月1日
30	南方基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年5月29日
31	南方基金关于南方永利基金增加汉口银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年5月19日
32	南方基金关于旗下部分基金增加创金启富为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年5月11日
33	南方基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年5月7日
34	南方永利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)开放申购、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年5月4日
35	南方基金管理有限公司深圳分公司负责人等信息变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月28日
36	南方基金管理有限公司关于公司高级管理人员在子公司兼职情况变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月23日
37	南方基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月18日
38	南方基金关于旗下部分基金增加河北银行为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月17日
39	关于电子直销业务增加苏宁易购第三方支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月15日
40	南方永利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月14日
41	南方基金关于淘宝直营店销售手续费费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月10日

42	南方基金关于旗下部分基金增加增财基金为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年3月31日
43	南方基金关于旗下部分基金增加联泰资产为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年3月23日
44	南方基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年3月17日
45	南方基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低赎回限额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年2月25日
46	南方基金关于旗下部分基金增加海银基金为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年2月12日
47	南方基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年2月12日
48	南方永利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年1月15日

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方永利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）的文件。
- 2、南方永利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）基金合同
- 3、南方永利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）托管协议
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>