

南方理财金交易型货币市场基金 2016 年 半年度报告

2016 年 6 月 30 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

送出日期：2016 年 8 月 29 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。本半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 2016 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 债券回购融资情况.....	31
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	31
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	32
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	33
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	33
7.8 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.....	33
7.9 投资组合报告附注.....	33
§8 基金份额持有人信息	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	35
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	35

8.4 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.....	35
§9 开放式基金份额变动.....	36
§10 重大事件揭示.....	36
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
10.2 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.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变.....	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	36
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	38
10.9 其他重大事件.....	38
§11 备查文件目录.....	42
11.1 备查文件目录.....	42
11.2 存放地点.....	42
11.3 查阅方式.....	42

§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	
场内简称	理财金 H	
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	447,015,998.60 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	2015-01-05	
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	236,218,896.25 份	210,797,102.35 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	林葛
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-68121816
注册地址		深圳市福田区中心区福华一路	北京东城区建国门内大街 69 号

	六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	
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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518048	100031
法定代表人	吴万善	周慕冰

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构（理财金 A）	南方基金管理有限公司	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
注册登记机构（理财金 H）	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	理财金 A	理财金 H
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日）	报告期（2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	5,697,769.21	212,355,031.92
本期利润	5,697,769.21	212,355,031.92
本期净值收益率	1.2377%	1.2389%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）	
期末基金资产净值	236,218,896.25	21,079,710,234.83
期末基金份额净值	1.00	100.00
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）	
累计净值收益率	5.1178%	5.1217%

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
过去一个月	0.2026%	0.0012%	0.1126%	0.0000%	0.0900%	0.0012%
过去三个月	0.5893%	0.0010%	0.3418%	0.0000%	0.2475%	0.0010%
过去六个月	1.2377%	0.0014%	0.6810%	0.0000%	0.5567%	0.0014%
过去一年	2.6272%	0.0033%	1.3819%	0.0000%	1.2453%	0.0033%
自基金合同生效起至今	5.1178%	0.0047%	2.1758%	0.0000%	2.9420%	0.0047%

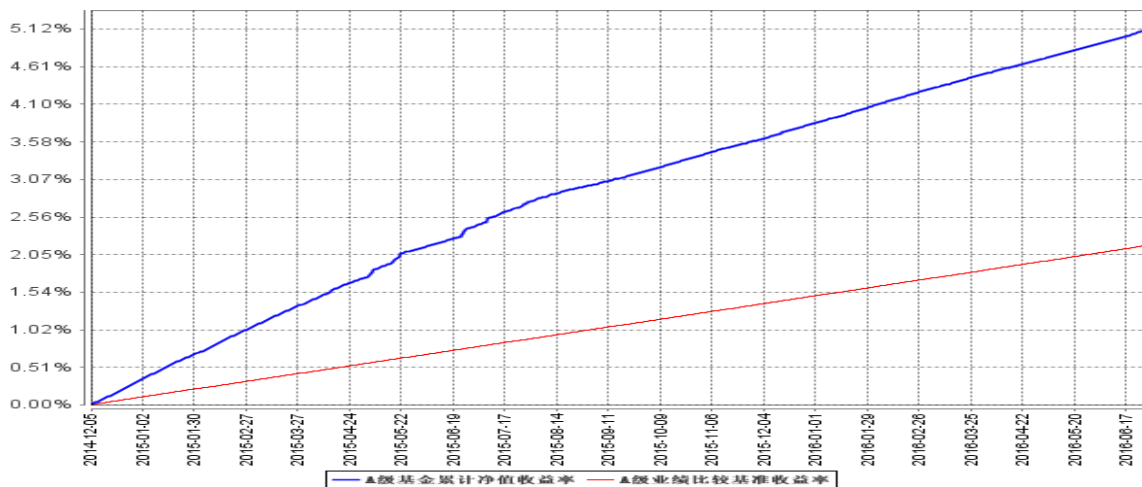
理财金 H

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
过去一个月	0.2032%	0.0012%	0.1126%	0.0000%	0.0906%	0.0012%
过去三个月	0.5902%	0.0010%	0.3418%	0.0000%	0.2484%	0.0010%
过去六个月	1.2389%	0.0014%	0.6810%	0.0000%	0.5579%	0.0014%
过去一年	2.6303%	0.0033%	1.3819%	0.0000%	1.2484%	0.0033%
自基金合同生效起至今	5.1217%	0.0047%	2.1758%	0.0000%	2.9459%	0.0047%

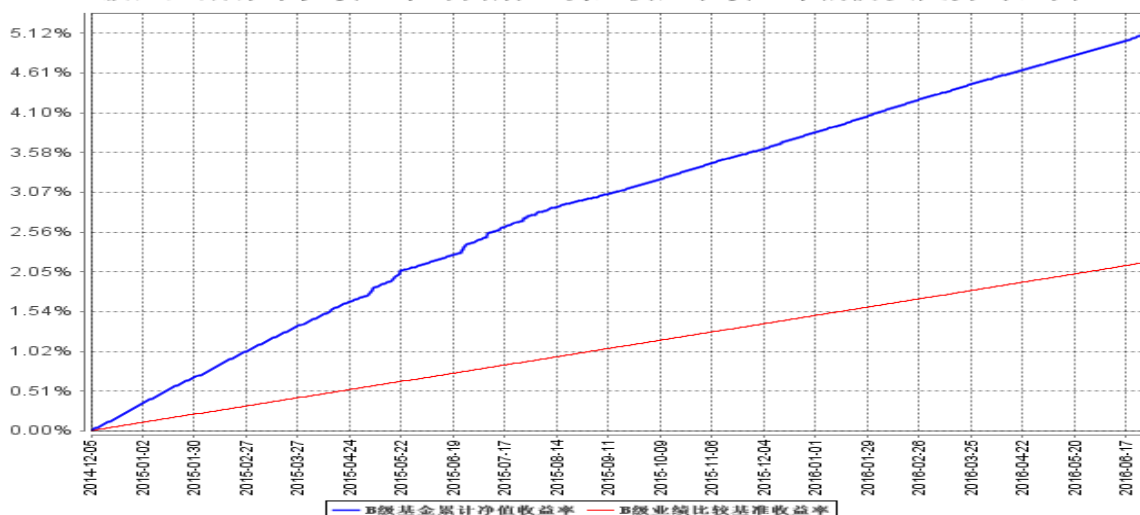
注：本基金收益分配为按日结转份额。

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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日至本报告期末未满一年。本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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5,600亿元，旗下管理96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		
夏晨曦	本基金基金经理	2014 年 12 月 5 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。2008 年 5 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；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，任南方现金增利基金经理；2014 年 7 月至今，任南方现金通基金经理；2014 年 7 月至今，任南方薪金宝基金经理；2014 年 12 月至今，任南方理财金基金经理；2016 年 2 月至今，任南方日添益货币基金经理。
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。

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，除首任基金经理外，“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，没有损害基金持有人利益。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，两两组合间单日、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。

4.3.2 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。

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

2016年上半年经济增速整体继续放缓，但出现了一定波动。一季度经济基本面状况出现好转，全国规模以上工业企业利润同比增长转正，PPI和CPI同比增速回升。大宗商品出现暴涨，市场风险偏好回升。进入二季度后，经济增速出现放缓，房地产销售增速下降，带动投资从高点回落。投资者风险偏好重新出现下降。企业去杠杆过程仍在进行中，社会融资规模也较一季度出现下降。在经济增速放缓、物价水平低位运行的基本面背景下，货币政策保持了稳健的取向，央行着力维持资金面的稳定并意在通过公开市场操作等方式构建利率走廊，资金利率呈窄幅波动。市场方面，以1年期AAA短期融资券为例，收益率在2.7%-3.0%左右区间窄幅波动。上半年，信用风险成为市场关注的焦点之一，个券违约风险的持续发酵使得低等级信用债利差大幅扩大，以两高一剩行业为代表的个券估值大幅上行。上半年，本基金在做好流动性管理的前提下，采取了相对积极的久期策略及杠杆策略，意在保持相对较高的静态收益水平，同时积极尝试通过大额存单、债券等的波段操作获取超额收益。上半年，本基金高度关注信用风险，依托公司的信用分析平台严格进行持仓个券及新增投资个券的信用筛查，确保基金不出现信用风险暴露。

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 1.2377%，同期业绩比较基准收益率为 0.6810%。H 级基金净值收益率为 1.2389%，同期业绩比较基准收益率为 0.6810%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

6 月底以来国际金融市场的风险偏好迅速降低，美元指数大幅上涨，各国国债收益率屡创历史新低，市场对美联储加息的预期再度转向。受国外环境影响，国内债券收益率也出现了显著下行。我们对下半年市场整体偏乐观。一方面，国际环境动荡导致未来全球增长前景暗淡，即使国内经济增长状况边际好转，但大幅反弹向上的条件并不具备。另一方面，人民币贬值的预期在央行中间价调控下得以稳定，不会造成外汇占款大量减少的情况。央行货币政策预计仍将保持短端利率稳定，通过公开市场操作维持市场资金平衡。考虑到前期收益率曲线过于平坦化的特征将得到一定程度的修复，我们认为收益率曲线短端将出现一定程度的陡峭化下行，高久期策略将获取阶段性的资本利得收益。同时，我们将在做好流动性管理的基础上通过适度的杠杆操作来获取超额收益。下半年，本基金仍将高度关注信用风险，信用债持仓结构上以高等级为主，对个券资质进行严格的筛查，降低信用风险事件发生概率。

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

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 218,052,801.13 元,实际分配收益 218,052,801.13 元。

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

在托管本基金的过程中,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》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—南方基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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、2016 年 5 月 25 日以及 2016 年 6 月 13 日,南方理财金交易型货币市场基金,所持现金类资产比例合计低于基金资产净值的 5%,违反了《货币市场基金监督管理办法》第七条中“货币市场基金应当保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求,其投资组合应当符合现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%”的规定。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 托管人对本半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本基金半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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	7,803,594,006.83	5,315,248,424.98
结算备付金		389,092,503.09	17,134,148.84
存出保证金		46,732.05	19,495.02
交易性金融资产	6.4.4.2	12,417,270,280.23	4,967,197,007.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		12,417,270,280.23	4,967,197,007.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	884,348,056.52	2,360,257,540.38
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.4.5	76,815,349.54	50,080,163.08
应收股利		-	-
应收申购款		6,836,275.29	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	1,740.00	3,406.67
资产总计		21,578,004,943.55	12,709,940,186.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 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	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		250,000,000.00	21,499,872.25
应付证券清算款		26,468.57	-
应付赎回款		500.00	499.25
应付管理人报酬		5,372,195.04	2,440,231.53
应付托管费		1,790,731.66	813,410.52
应付销售服务费		4,476,829.19	2,033,526.29
应付交易费用	6.4.4.7	148,971.69	59,026.00
应交税费		-	-
应付利息		-	1,374.99

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	260,116.32	200,000.75
负债合计		262,075,812.47	27,047,941.58
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	21,315,929,131.08	12,682,892,244.99
未分配利润	6.4.4.10	-	-
所有者权益合计		21,315,929,131.08	12,682,892,244.99
负债和所有者权益总计		21,578,004,943.55	12,709,940,186.57

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，A 级基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额

236,218,896.25 份，H 级基金份额净值 100.0000 元，基金份额总额 210,797,102.35 份。

6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		281,494,543.01	43,935,056.05
1.利息收入		262,226,648.84	40,426,587.71
其中：存款利息收入	6.4.4.11	118,809,446.89	25,519,389.73
债券利息收入		130,563,810.03	11,488,931.26
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,853,391.92	3,418,266.72
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,267,894.17	3,508,468.34
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	19,267,894.17	3,508,468.34
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.4.14	-	-
衍生工具收益	6.4.4.15	-	-
股利收益	6.4.4.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	-	-
减：二、费用		63,441,741.88	7,316,016.70

1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	26,645,481.97	2,660,169.66
2. 托管费	6.4.7.2.2	8,881,827.31	886,723.20
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	22,204,568.31	2,216,807.94
4. 交易费用	6.4.4.19	-	-
5. 利息支出		5,318,679.62	1,244,443.71
其中：卖出回购金融资产支出		5,318,679.62	1,244,443.71
6. 其他费用	6.4.4.20	391,184.67	307,872.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		218,052,801.13	36,619,039.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		218,052,801.13	36,619,039.35

6.3 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6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30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）	-	218,052,801.13	218,052,801.13
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）	8,633,036,886.09	-	8,633,036,886.09
其中：1. 基金申购款	42,640,727,113.89	-	42,640,727,113.89
2. 基金赎回款	-34,007,690,227.80	-	-34,007,690,227.80
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）	-	-218,052,801.13	-218,052,801.13
五、期末所有者权益（基金净值）	21,315,929,131.08	-	21,315,929,131.08
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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)	-	36,619,039.35	36,619,039.35
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)	-2,337,212,757.57	-	-2,337,212,757.57
其中：1.基金申购款	6,048,222,048.16	-	6,048,222,048.16
2.基金赎回款	-8,385,434,805.73	-	-8,385,434,805.73
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)	-	-36,619,039.35	-36,619,039.35
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,230,853,153.30	-	1,230,853,153.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨小松</u>	<u>徐超</u>	<u>徐超</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 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。

6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 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[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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	1,594,006.83
定期存款	7,802,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	-

存款期限 1 个月以内	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计:	7,803,594,006.83

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	559,371,110.58	559,375,532.70	4,422.12	0.0000%
	银行间市场	11,857,899,169.65	11,859,747,000.00	1,847,830.35	0.0087%
	合计	12,417,270,280.23	12,419,122,532.70	1,852,252.47	0.0087%

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.4.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	100,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	784,348,056.52	-
合计	884,348,056.52	-

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,887.88
应收定期存款利息	28,364,588.91
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	237,673.58
应收债券利息	41,128,213.55
应收买入返售证券利息	913,386.87
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	6,168,598.75
合计	76,815,349.54

6.4.4.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	1,740.00
待摊费用	-
合计	1,740.00

6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	148,971.69
合计	148,971.69

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	260,116.32
合计	260,116.32

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

理财金 A	
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	425,907,584.92	425,907,584.92
本期申购	1,218,475,681.97	1,218,475,681.97
本期赎回(以“-”号填列)	-1,408,164,370.64	-1,408,164,370.64
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期末	236,218,896.25	236,218,896.25

金额单位：人民币元

理财金 H		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	122,569,846.60	12,256,984,660.07
本期申购	414,222,514.32	41,422,251,431.92
本期赎回(以“-”号填列)	-325,995,258.57	-32,599,525,857.16
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期末	210,797,102.35	21,079,710,234.83

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

理财金 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	5,697,769.21	-	5,697,769.21
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-5,697,769.21	-	-5,697,769.21
本期末	-	-	-

单位：人民币元

理财金 H			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	212,355,031.92	-	212,355,031.92
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-212,355,031.92	-	-212,355,031.92
本期末	-	-	-

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	161,887.01
定期存款利息收入	116,061,179.21
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,567,295.34
其他	19,085.33
合计	118,809,446.89

6.4.4.12 股票投资收益

注：无。

6.4.4.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	27,149,233,613.32
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	27,028,150,705.76
减：应收利息总额	101,815,013.39
买卖债券差价收入	19,267,894.17

6.4.4.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.4.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.4.16 股利收益

注：无。

6.4.4.17 公允价值变动收益

注：无。

6.4.4.18 其他收入

注：无。

6.4.4.19 交易费用

注：无。

6.4.4.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	72,102.94
信息披露费	149,178.12
其他	208.51
上市年费	29,835.26
银行汇划费	88,759.84
银行间转托管费	32,500.00
账户维护费	18,600.00
合计	391,184.67

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.5.1 或有事项**

无。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.6 关联方关系**6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.7.1.1 股票交易**

注：无。

6.4.7.1.2 债券交易

注：无。

6.4.7.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.7.1.4 权证交易

无。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.7.2 关联方报酬**6.4.7.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	26,645,481.97	2,660,169.66
其中：支付销售机构的客户维护费	3,612,983.01	394,948.87

注：支付基金管理人南方基金管理人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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	8,881,827.31	886,723.20

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 0.1% 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 0.1% / 当年天数。

6.4.7.2.3 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 6 月 30 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	339,734.85	-	339,734.85
华泰证券	2,760.59	-	2,760.59
中国农业银行	82,094.19	-	82,094.19
合计	424,589.63	-	424,589.63
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 6 月 30 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	477,859.29	-	477,859.29
中国农业银行	484,658.70	-	484,658.70
合计	962,517.99	-	962,517.99

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公司，再由南方基金公司计算并支付给各基金销售机构。A 级基金份额和 H 级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 = 前一日基金资产净值 X 约定年费率 / 当年天数

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	理财金 A	理财金 H
基金合同生效日（2014 年	-	-

12月5日)持有的基金份额		
期初持有的基金份额	-	103,827.00
期间申购/买入总份额	-	1,287.00
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	105,114.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.0499%

项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	理财金 A	理财金 H
基金合同生效日(2014年 12月5日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	102,412.00
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	102,412.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.0217%

注:1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额,期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2. 基金管理人南方基金 在上年度可比期间申购本基金 H 类基金份额的交易委托华泰证券办理,按照本基金招募说明书的规定收取费用。

6.4.7.4.2 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

理财金 H

份额单位:份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
华泰证券	9,519,309.00	4.5159%	1,673,365.00	1.3700%

注:报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.7.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	1,594,006.83	161,887.01	222,152.30	46,583.50

注：本基金的银行活期存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 利润分配情况

6.4.8.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

理财金A

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	本期利润分配合计	备注
5,697,769.21	-	-	5,697,769.21	-

理财金H

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	本期利润分配合计	备注
212,355,031.92	-	-	212,355,031.92	-

6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

注：无。

6.4.9.1 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.1.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0。

6.4.9.1.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30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25,000,000.00元，于2016年7月1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。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，投资于各类货币市场工具，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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。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，将风险控制可在承受的范围之内。

6.4.10.2 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。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行中国农业银行，定期存款存放在具有基金托管资格的上海银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、民生银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，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。

6.4.10.3 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随时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。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资于一家公司发行的短期企业债券的比例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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还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，在全国银行间债券市场回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 20%。

于 2016 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中 250,000,000.00 元将在一个月内到期且计息(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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.4.1 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。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，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。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	6个月以内	6个月-1年	不计息	合计
资产				
银行存款	7,803,594,006.83	-	-	7,803,594,006.83
结算备付金	389,092,503.09	-	-	389,092,503.09
存出保证金	46,732.05	-	-	46,732.05
交易性金融资产	10,869,521,806.13	1,547,748,474.10	-	12,417,270,280.23
买入返售金融资产	884,348,056.52	-	-	884,348,056.52
应收利息	-	-	76,815,349.54	76,815,349.54
应收申购款	593,097.27	-	6,243,178.02	6,836,275.29
其他资产	-	-	1,740.00	1,740.00
资产总计	19,947,196,201.89	1,547,748,474.10	83,060,267.56	21,578,004,943.55
负债				
卖出回购金融资产款	250,000,000.00	-	-	250,000,000.00
应付证券清算款	-	-	26,468.57	26,468.57
应付赎回款	-	-	500.00	500.00
应付管理人报酬	-	-	5,372,195.04	5,372,195.04
应付托管费	-	-	1,790,731.66	1,790,731.66
应付销售服务费	-	-	4,476,829.19	4,476,829.19
应付交易费用	-	-	148,971.69	148,971.69
其他负债	-	-	260,116.32	260,116.32
负债总计	250,000,000.00	-	12,075,812.47	262,075,812.47
利率敏感度缺口	19,697,196,201.89	1,547,748,474.10	70,984,455.09	21,315,929,131.08
上年度末 2015年12月31日	6个月以内	6个月-1年	不计息	合计
资产				
银行存款	5,215,248,424.98	100,000,000.00	-	5,315,248,424.98
结算备付金	17,134,148.84	-	-	17,134,148.84
存出保证金	19,495.02	-	-	19,495.02
交易性金融资产	4,457,418,383.58	509,778,624.02	-	4,967,197,007.60

买入返售金融资产	2,360,257,540.38	-	-	2,360,257,540.38
应收利息	-	-	50,080,163.08	50,080,163.08
其他资产	-	-	3,406.67	3,406.67
资产总计	12,050,077,992.80	609,778,624.02	50,083,569.75	12,709,940,186.57
负债				
卖出回购金融资产款	21,499,872.25	-	-	21,499,872.25
应付赎回费	-	-	499.25	499.25
应付管理人报酬	-	-	2,440,231.53	2,440,231.53
应付托管费	-	-	813,410.52	813,410.52
应付销售服务费	-	-	2,033,526.29	2,033,526.29
应付交易费用	-	-	59,026.00	59,026.00
应付利息	-	-	1,374.99	1,374.99
其他负债	-	-	200,000.75	200,000.75
负债总计	21,499,872.25	-	5,548,069.33	27,047,941.58
利率敏感度缺口	12,028,578,120.55	609,778,624.02	44,535,500.42	12,682,892,244.99

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

6.4.10.4.1.2 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：人民币万元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降25个基点	增加约955	增加约341
	市场利率上升25个基点	减少约953	减少约341

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.4.3 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。本基金主要投资于定期存款和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告**7.1 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	固定收益投资	12,417,270,280.23	57.55
	其中: 债券	12,417,270,280.23	57.55
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	884,348,056.52	4.10
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	8,192,686,509.92	37.97
4	其他各项资产	83,700,096.88	0.39
5	合计	21,578,004,943.55	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额		3.13
	其中: 买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	250,000,000.00	1.17
	其中: 买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注: 1、报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

2、在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天”。本报告期内，本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	24.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	11.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	17.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	32.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	14.91	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.84	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内，本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

7.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	559,371,110.58	2.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	499,570,355.25	2.34
	其中：政策性金融债	499,570,355.25	2.34
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,919,536,865.28	9.01
6	中期票据	251,672,098.98	1.18
7	同业存单	9,187,119,850.14	43.10
8	其他	-	-
9	合计	12,417,270,280.23	58.25
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	111693524	16 广州农村商业银行 CD063	8,500,000	839,871,804.28	3.94
2	111691887	16 南京银行 CD035	6,500,000	650,000,000.00	3.05
3	111611236	16 平安 CD236	5,000,000	496,609,856.49	2.33
4	111692615	16 东莞银行 CD023	4,500,000	450,000,000.00	2.11
5	111694721	16 中原银行 CD053	4,000,000	397,234,718.93	1.86
6	111609196	16 浦发 CD196	4,000,000	395,307,689.27	1.85
7	111611187	16 平安 CD187	4,000,000	395,234,767.22	1.85
8	111694693	16 长安银行 CD025	4,000,000	387,202,501.28	1.82
9	150215	15 国开 15	3,600,000	359,997,453.87	1.69
10	111610016	16 兴业 CD016	3,200,000	319,713,878.46	1.50

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1038%
报告期内偏离度的最低值	0.0015%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0450%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：没有超过 0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：没有超过 0.5%情况。

7.8 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：无。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

本基金采用“摊余成本法”计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

7.9.2

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。

7.9.3 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	46,732.05
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	76,815,349.54
4	应收申购款	6,836,275.29
5	其他应收款	1,740.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	83,700,096.88

§8 基金份额持有人信息

8.1 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	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
理财金 A	13,938	16,947.83	73,409,947.27	31.08%	162,808,948.98	68.92%
理财金 H	8,674	24,302.18	176,452,993.21	83.71%	34,344,109.14	16.29%
合计	22,612	19,768.97	249,862,940.48	55.90%	197,153,058.12	44.10%

注：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）。

8.2 期末上市基金前十名持有人

理财金 H

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	南方资本—工商银行—银华财富资本管理（北京）有限公司	13,495,777.00	6.40%
2	银华财富资本—工商银行—银华财富资本管理（北京）有限公司	10,006,018.00	4.75%
3	安信证券股份有限公司	10,000,779.00	4.74%
4	瑞士信贷(香港)有限公司	7,104,717.00	3.37%
5	UBS AG	6,510,869.00	3.09%
6	华泰瑞联基金管理有限公司—江苏华泰瑞联并购基金（有限合伙）	5,206,356.00	2.47%
7	中信信诚资产—招商银行—郁金香信金 1 号专项资产管理计划	4,991,612.00	2.37%
8	广发证券—广发—广发金管家多添利集合资产管理计划	4,833,144.00	2.29%
9	国联证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	4,430,312.00	2.10%
10	天安财产保险股份有限公司—保赢 1 号	4,202,110.00	1.99%

注：持有人为场内持有人。

8.3 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	理财金 A	-	-
	理财金 H	112,275.88	0.0533%
	合计	112,275.88	0.0251%

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)。

8.4 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

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额，本基金基金经理未持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	理财金 A	理财金 H
基金合同生效日（2014 年 12 月 5 日）基金份额总额	2,551,012,171.44	10,051,310.00
本报告期期初基金份额总额	425,907,584.92	122,569,846.60
本报告期基金总申购份额	1,218,475,681.97	414,222,514.32
减：本报告期基金总赎回份额	1,408,164,370.64	325,995,258.57
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	236,218,896.25	210,797,102.35

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期内，基金管理人没有发生重大人事变动。

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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 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	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 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
国泰君安	139,824,951.23	28.36%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	353,169,306.33	71.64%	37,589,500,000.00	100.00%	-	-

注：1、本期无租用证券公司交易单元的变更情况。

2、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

- a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- b、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；
- c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- d、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交易单元：

- a、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；
- b、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；
- c、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。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：无。

10.9 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	南方基金关于旗下部分基金增加余杭农村商业银行代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年 6月23日
2	南方基金关于旗下部分基金增加泰隆银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年 6月3日
3	南方基金关于旗下部分基金增加宁波银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年 6月2日
4	南方理财金交易型货币市场基金 2016 年端午节前暂停申购及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年 6月2日
5	南方基金关于旗下部分基金增加潍坊银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年 5月26日

6	南方基金关于旗下部分基金增加汇成基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 5 月 13 日
7	南方基金关于旗下部分基金增加天津银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 5 月 10 日
8	关于南方理财金交易型货币市场基金变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 30 日
9	南方理财金交易型货币市场基金 2016 年五一节前暂停申购及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 21 日
10	南方基金关于旗下部分基金增加徽商银行和广东南粤银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 20 日
11	南方基金关于旗下部分基金增加德州银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 15 日
12	关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 12 日
13	南方基金管理有限公司电子交易赎回转认/申购业务规则	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 28 日
14	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	2016 年 3 月 25 日
15	南方理财金交易型货币市场基金 2016 年清明节前暂停申购及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 25 日
16	南方基金关于旗下部分基金增加鼎信汇金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 9 日
17	南方基金关于临时暂停电子直销实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 15 日
18	南方基金关于旗下部分基金增加南商（中国）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	2016 年 2 月 4 日

19	南方基金关于旗下部分基金增加中经北证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	2016 年 1 月 29 日
20	南方理财金交易型货币市场基金 2016 年春节前暂停申购及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 28 日
21	南方基金关于旗下部分基金增加晋商银行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	2016 年 1 月 27 日
22	南方基金关于旗下部分基金增加中证金牛为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 26 日
23	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	2016 年 1 月 25 日
24	南方基金关于南方理财金基金增加唐鼎耀华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	2016 年 1 月 18 日
25	南方基金关于电子直销平台通过货币基金定投其他基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 15 日
26	南方理财金交易型货币市场基金招募说明书（更新）摘要（2015 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 12 日
27	南方理财金交易型货币市场基金招募说明书（更新）（2015 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 12 日
28	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	2016 年 1 月 8 日
29	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	2016 年 1 月 8 日
30	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
31	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日

32	南方基金关于旗下理财金 H 增加天风证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 24 日
33	南方理财金交易型货币市场基金 2016 年端午节前暂停申购及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 2 日
34	南方基金关于旗下 500ETF、理财金 H 增加相关券商为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 5 月 27 日
35	南方基金关于旗下 500ETF、理财金 H 增加相关券商为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 29 日
36	南方理财金交易型货币市场基金 2016 年五一节前暂停申购及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 21 日
37	南方基金关于理财金 H 增加华融证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 19 日
38	关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 12 日
39	南方基金管理有限公司电子交易赎回转认/申购业务规则	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 28 日
40	南方理财金交易型货币市场基金 2016 年清明节前暂停申购及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 25 日
41	关于南方理财金交易型货币市场基金 H 类基金份额调整最小申购、赎回单位数额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 15 日
42	南方基金关于临时暂停电子直销实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 15 日
43	南方基金关于理财金 H 增加华西证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 1 日
44	南方理财金交易型货币市场基金 2016 年春节前暂停申购及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 28 日
45	南方基金关于理财金 H 增加长江证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 22 日

46	南方基金关于电子直销平台通过货币基金定投其他基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 15 日
47	南方基金关于理财金 H 增加招商证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 14 日
48	南方理财金交易型货币市场基金招募说明书（更新）摘要（2015 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 12 日
49	南方理财金交易型货币市场基金招募说明书（更新）（2015 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 12 日
50	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
51	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方理财金交易型货币市场基金的文件。
- 2、南方理财金交易型货币市场基金合同。
- 3、南方理财金交易型货币市场基金托管协议。
- 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。

11.2 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

11.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>