

南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金 (LOF) 2016 年年度报告摘要

2016 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：2017 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示

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12月31日止。

§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	158,428,786.72 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 年 6 月 6 日	
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	153,001,192.93 份	5,427,593.79 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	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798

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	2016年		2015年		2014年	
	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	-13,585,109.20	-483,627.80	68,224,256.44	-127,911.19	38,594,773.13	290,527.24
本期利润	-10,237,328.47	-422,573.40	20,153,778.61	-1,066,835.32	231,616,975.47	602,378.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0539	-0.0604	0.0743	-0.1649	0.1210	0.3926
本期加权平均净值利润率	-5.59%	-6.30%	6.53%	-15.88%	51.47%	36.70%
本期基金份额净值增长率	-3.57%	-3.99%	1.47%	1.10%	42.97%	40.19%
3.1.2 期末数据和	2016年末		2015年末		2014年末	

指标						
期末可供分配利润	-	-	-	-510,454.41	46,333,954.28	222,824.60
期末可供分配基金份额利润	-0.1565	-0.1643	-0.0498	-0.0543	0.1460	0.1437
期末基金资产净值	144,524,033.38	5,094,556.64	240,426,459.28	9,186,487.53	427,625,069.95	2,090,751.61
期末基金份额净值	0.945	0.939	0.980	0.978	1.348	1.348

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	-5.59%	0.50%	0.61%	0.01%	-6.20%	0.49%
过去六个月	-0.84%	0.50%	1.21%	0.01%	-2.05%	0.49%
过去一年	-3.57%	0.53%	2.44%	0.01%	-6.01%	0.52%
过去三年	39.89%	0.98%	8.35%	0.10%	31.54%	0.88%
自基金合同	40.87%	0.89%	13.07%	0.09%	27.80%	0.80%

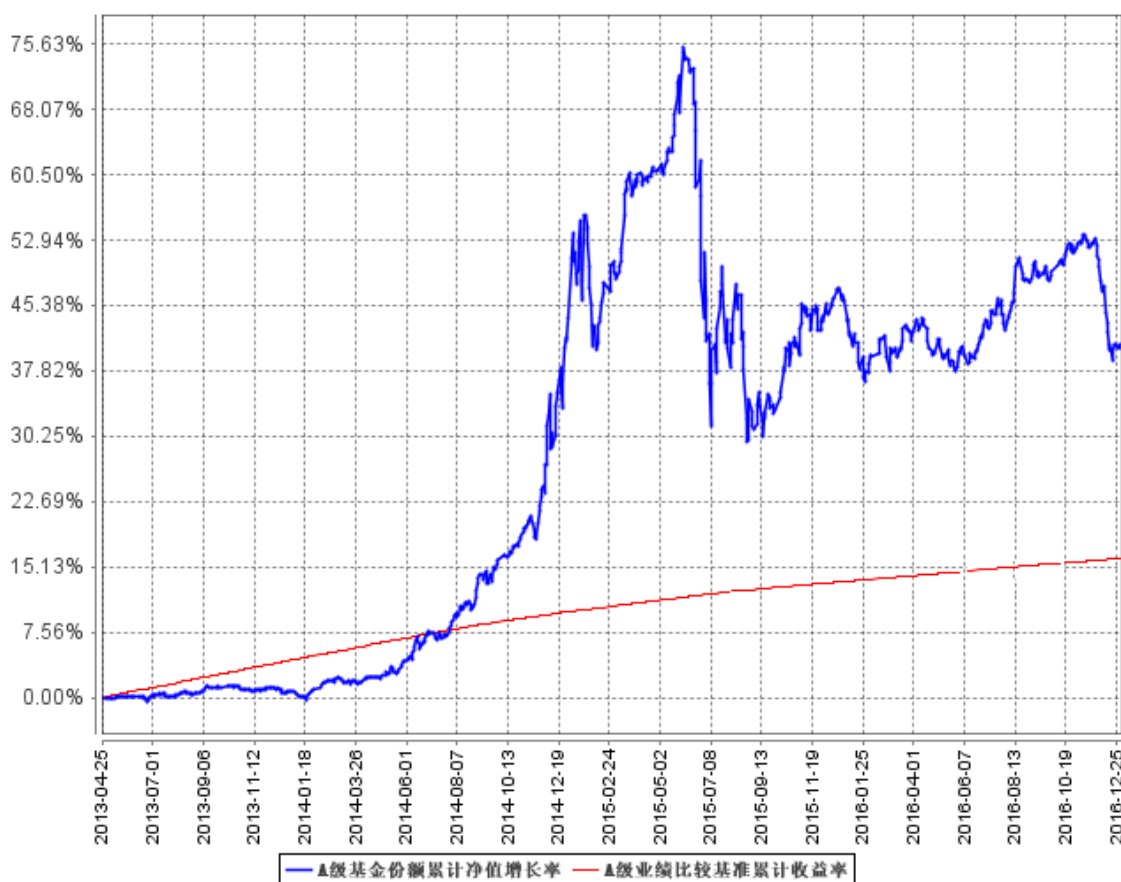
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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	-5.72%	0.50%	0.63%	0.01%	-6.35%	0.49%
过去六个月	-1.05%	0.50%	0.66%	0.05%	-1.71%	0.45%
过去一年	-3.99%	0.53%	1.94%	0.04%	-5.93%	0.49%
自基金合同生效起至今	36.09%	1.04%	8.84%	0.11%	27.25%	0.93%

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

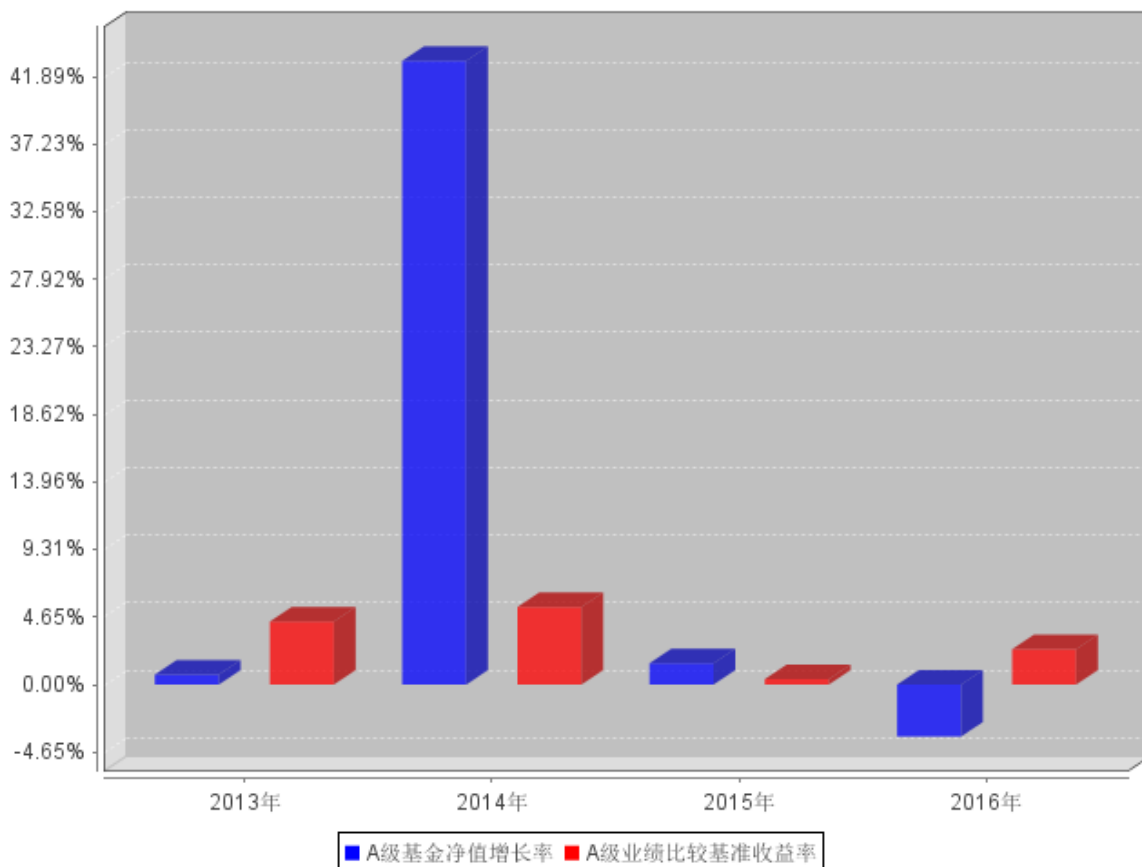


注：1. 基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

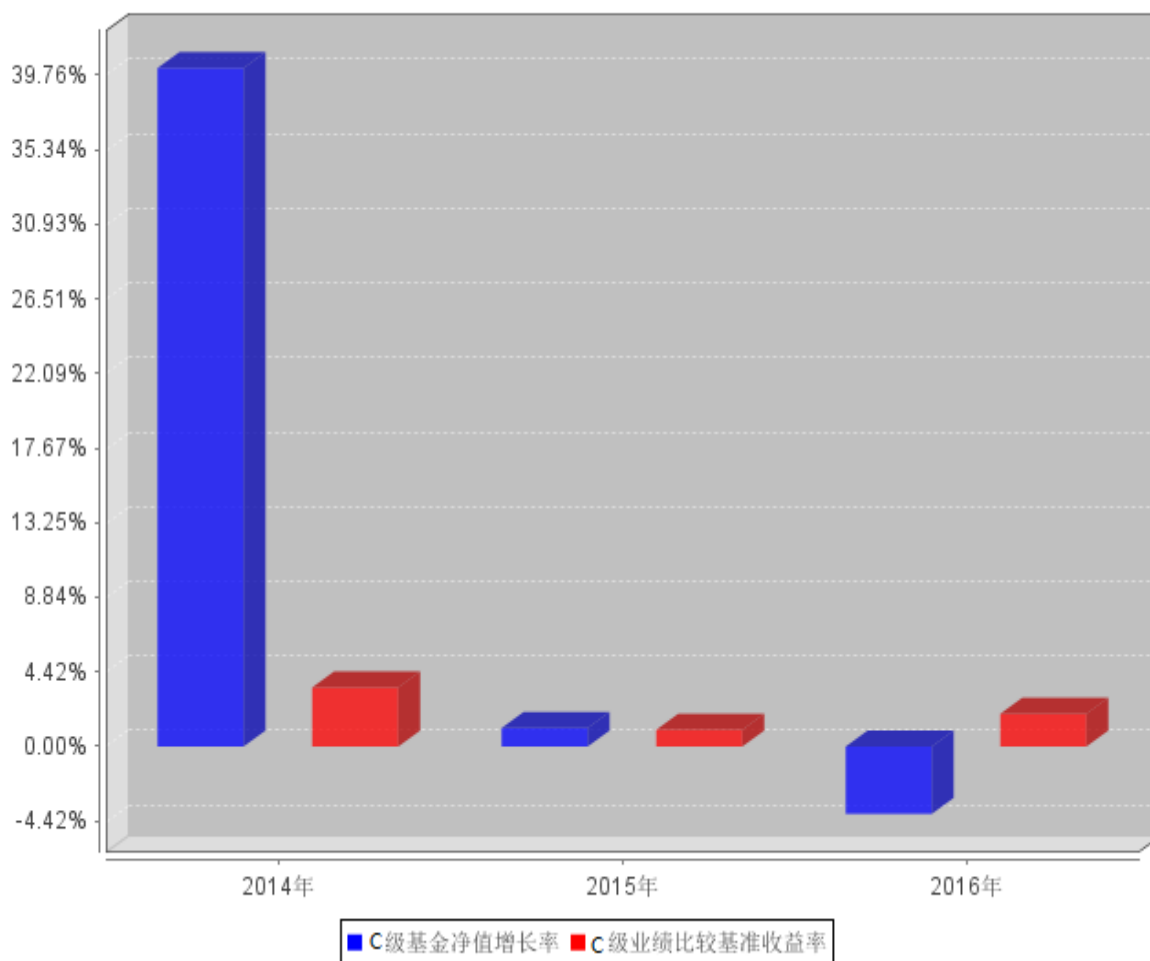
2. 本基金自2014年4月28日起增加C类收费模式，原有收费模式称为A类。

3.2.3 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



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
2016	-	-	-	-	
2015	3.9500	89,092,903.89	28,146,916.81	117,239,820.70	
2014	0.7100	98,789,692.32	23,169,998.78	121,959,691.10	
合计	4.6600	187,882,596.21	51,316,915.59	239,199,511.80	

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
2016	-	-	-	-	
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	
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		
韩亚庆	本基 金基 金经 理	2013 年 4月 25日	2016 年 11 月 25日	16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，2013年10月至2016年11月，任固定收益投资决策委员会委员；2014年12月至2016年11月，任固定收益部总监；2008年11月至2016年11月，任南方现金基金经理；2010年11月至2016年11月，任南方广利基金经理；2013年4月至2016年11月，任南方永利基金经理；2015年11月至2016年11月，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	-	4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，历任固定收益部转债研究员、宏观研究员、信用分析师；2015年2月至2015年8月，任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；2016年6月至今，任南方广利基金经理；2016年7月至今，任南方甌智混合基金经理；2016年11月至今，任南方荣发、南方卓元基金经理。

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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《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

2016 年 1-10 月利率债收益率震荡下行，信用利差、期限利差、流动性溢价显著压缩，债券市场表现较好，11、12 月在经济数据企稳回升、金融数据超预期、通胀上行、资金利率抬升且波动性加大、海外债市大幅调整等多重利空因素驱动下，债市大幅调整，全年来看，10 年国债、国开债收益率较 2015 年末分别上行 19BP、55BP，信用利差较 2015 年末仍有所下降，全年中债总财富指数小幅上涨 1.28%；2016 年权益市场先抑后扬，在年初熔断行情之后震荡上行，年底略有回调，可转债市场估值 1 月、12 月分别遭受供给冲击和流动性冲击，表现弱于正股，全年来看沪深 300 指数下跌 11.28%，中证转债指数下跌 11.76%。南方永利基金纯债方面上半年以持有信用债为主，保持了较短的久期水平，三季度参与长端利率债交易，组合久期和杠杆较高，在 11、12 月债市调整过程中陆续减仓利率债，组合久期和杠杆明显降低，但市场调整的速度和幅度超预期，12 月中下旬在债市初步企稳、收益率曲线十分平坦的背景下，择机增加了中短端信用债的配置；权益方面，年初股票和可转债仓位较高，熔断行情中净值受伤较重，上半年在市场阶段性调整中陆续提高可转债仓位，7-10 月份市场震荡上行过程中净值快速回升，11 月中旬开始减仓股票和可转债，但 11 月底开始的资金面紧张使得可转债流动性快速下降，估值大幅压缩，12 月可转债仓位受伤较重。全年来看，年初熔断和可转债估值压缩以及年底股债双杀对基金净

值伤害较大，全年收益不佳，未来将在深刻反思和总结的基础上，努力追求风险调整后的收益最大化。

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-3.57%，本报告期基金 C 级净值增长率为-3.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

纯债市场方面，全球贸易出现回升迹象，补库存上行周期仍在持续，融资需求较为旺盛，预计一季度经济数据平稳，房地产调控对经济的影响仍需观察，需求端相对稳定、供给端收缩的背景下生产资料价格仍然面临上行压力，并逐步向生活资料价格传导，油价企稳回升也带来一定的输入性通胀压力，预计一季度 PPI 同比增速继续上冲，CPI 同比春节后有所下降，此后陆续上行，中央经济工作会议定调货币政策保持稳健中性，调节好货币闸门，把防控金融风险放到更加重要的位置，着力防控资产泡沫，预计一季度流动性环境较 2016 年四季度难有改善。综合来看，一季度的基本面和政策组合仍对债券市场形成压制，但年初配置力量相对较强，市场表现应好于 2016 年四季度，预计整体呈现弱势格局，收益率曲线较为平坦的情况下，中短端品种的性价比较高。权益市场方面，短期经济数据平稳，改革持续推进，有利于提高市场风险偏好，市场可能迎来“春季行情”，但防控金融风险和资产泡沫的主基调下，需要警惕流动性收紧对于市场的影响，适当降低对指数涨幅的预期，重点把握改革、细分行业景气回升、成长白马估值调整到位等因素驱动的结构行情；2016 年 12 月下旬可转债超跌反弹，估值有所修复，目前估值的绝对水平并不便宜，依然容易受到流动性和供给冲击的影响，机会主要在个券层面。2017 年一季度，南方永利基金在纯债方面将以获取信用债持有收益为主，在严格控制信用风险的前提下重点关注中短端品种，根据资金面的变化灵活调整组合的杠杆水平；权益方面积极把握“春季行情”，坚持波段操作思路，灵活调整可转债仓位，及时止盈，重点挖掘可转债个券的超额收益。

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，购置外部专业机构制裁名单数据库，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

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%。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有收益分配事项。

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）无利润分配。

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）2016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

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 21508 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：南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金（LOF）

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	3,255,905.50	1,910,703.13
结算备付金	7,700,690.30	10,366,433.91
存出保证金	15,328.88	23,791.01
交易性金融资产	154,404,570.06	283,038,322.50
其中：股票投资	3,057,749.72	28,008,874.47
基金投资	-	-
债券投资	151,346,820.34	255,029,448.03
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	-	-
应收证券清算款	2,768,925.65	30,656,949.48
应收利息	1,511,481.18	3,979,917.24
应收股利	-	-
应收申购款	-	-

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	169,656,901.57	329,976,117.27
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016年12月31日	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	18,000,000.00	80,000,000.00
应付证券清算款	1,644,089.38	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	90,723.93	147,710.49
应付托管费	25,921.12	42,202.99
应付销售服务费	1,765.53	3,106.92
应付交易费用	20,342.83	15,150.06
应交税费	-	-
应付利息	468.76	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	255,000.00	155,000.00
负债合计	20,038,311.55	80,363,170.46
所有者权益:		
实收基金	158,428,786.72	254,695,301.53
未分配利润	-8,810,196.70	-5,082,354.72
所有者权益合计	149,618,590.02	249,612,946.81
负债和所有者权益总计	169,656,901.57	329,976,117.27

注：报告截止日2016年12月31日，基金份额总额158,428,786.72份，其中A类基金份额总额为153,001,192.93份，基金份额净值0.945元；C类基金份额总额为5,427,593.79份，基金份

额净值 0.939 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：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至 2016年12月31日	2015年1月1日至 2015年12月31日
一、收入	-6,528,236.67	26,083,624.13
1.利息收入	7,169,110.09	17,114,164.44
其中：存款利息收入	178,260.16	613,943.79
债券利息收入	6,990,849.93	16,475,233.25
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	24,987.40
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-17,106,181.89	57,975,999.96
其中：股票投资收益	-8,792,545.02	19,542,459.19
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-8,649,850.59	37,898,684.86
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	336,213.72	534,855.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	3,408,835.13	-49,009,401.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	2,861.69

列)		
减：二、费用	4,131,665.20	6,996,680.84
1. 管理人报酬	1,332,452.05	2,216,439.39
2. 托管费	380,700.69	633,268.36
3. 销售服务费	26,947.37	26,435.81
4. 交易费用	49,607.91	272,717.84
5. 利息支出	1,884,165.18	3,380,685.40
其中：卖出回购金融资产支出	1,884,165.18	3,380,685.40
6. 其他费用	457,792.00	467,134.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-10,659,901.87	19,086,943.29
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-10,659,901.87	19,086,943.29

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：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)	254,695,301.53	-5,082,354.72	249,612,946.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,659,901.87	-10,659,901.87

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)	-96,266,514.81	6,932,059.89	-89,334,454.92
其中：1. 基金申购款	2,353,443.61	-158,316.14	2,195,127.47
2. 基金赎回款	-98,619,958.42	7,090,376.03	-91,529,582.39
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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	158,428,786.72	-8,810,196.70	149,618,590.02
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)	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	-	-118,727,786.61	-118,727,786.61

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	254,695,301.53	-5,082,354.72	249,612,946.81

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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[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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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，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。

7.4.3 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、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。

7.4.4 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

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	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	12,771,783.94	56.18%	24,740,203.16	18.33%

7.4.4.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	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 成交总额的 比例
华泰证券	148,502,899.39	20.98%	133,996,784.95	13.64%

7.4.4.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
华泰证券	1,318,000,000.00	6.81%	286,100,000.00	0.99%

7.4.4.1.4 权证交易

注：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权证交易。

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	5,330.17	36.99%	5,330.17	37.34%
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 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%

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。

7.4.4.2 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年 12月31日	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	1,332,452.05	2,216,439.39
其中：支付销售机构的客户维护费	455,384.90	778,632.65

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0.7%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 0.7% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	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	380,700.69	633,268.36

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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 0.2% / 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		
	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	-	6,488.19	6,488.19
南方基金	-	2,928.86	2,928.86
兴业证券	-	155.79	155.79
合计	-	9,572.84	9,572.84
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		
	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

注：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。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间无各关联方投资本基金的情况。

7.4.4.5 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12月31日		2015年1月1日至2015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	3,255,905.50	39,296.95	1,910,703.13	53,810.13

注：本基金的银行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。

7.4.4.6 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					
2016年1月1日至2016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	113010	江南转债	网下申购	1,100	110,000.00
上年度可比期间					

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	-	-	-	-	-

7.4.4.7 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。

7.4.5 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配。

7.4.6 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 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流通受限证券。

7.4.6.2 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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113008	电气转债	2016年8月30日	重大事项	114.43	-	-	82,590	9,863,930.00	9,450,773.70	-

注：本基金截至2016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债券，该类债券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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 18,000,000.00 元，于 2017 年 1 月 3 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。

§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	3,057,749.72	1.80
	其中：股票	3,057,749.72	1.80
2	固定收益投资	151,346,820.34	89.21
	其中：债券	151,346,820.34	89.21
	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	10,956,595.80	6.46
7	其他各项资产	4,295,735.71	2.53
8	合计	169,656,901.57	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	394,091.45	0.26
C	制造业	1,052,322.16	0.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	296,633.97	0.20
E	建筑业	548,980.62	0.37
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	302,000.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	463,721.52	0.31
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	3,057,749.72	2.04

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600703	三安光电	56,461	756,012.79	0.51
2	600820	隧道股份	49,862	548,980.62	0.37
3	600028	中国石化	72,845	394,091.45	0.26
4	600109	国金证券	23,244	302,869.32	0.20
5	000089	深圳机场	37,750	302,000.00	0.20
6	601139	深圳燃气	32,633	296,633.97	0.20
7	600219	南山铝业	95,893	296,309.37	0.20
8	601318	中国平安	4,540	160,852.20	0.11

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于
<http://www.nffund.com> 的年度报告正文。

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	603658	安图生物	14,580.00	0.01
2	603336	宏辉果蔬	9,310.00	0.00
3	600977	中国电影	8,920.00	0.00
4	601611	中国核建	3,470.00	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	002521	齐峰新材	4,161,777.95	1.67
2	000089	深圳机场	3,882,382.83	1.56

3	600109	国金证券	2,278,744.63	0.91
4	002065	东华软件	2,254,649.72	0.90
5	600016	民生银行	1,973,987.32	0.79
6	600037	歌华有线	1,584,489.56	0.63
7	600219	南山铝业	1,572,906.13	0.63
8	002391	长青股份	1,344,901.24	0.54
9	601139	深圳燃气	1,289,363.72	0.52
10	002318	久立特材	920,868.75	0.37
11	600067	冠城大通	494,254.08	0.20
12	600026	中远海能	450,206.90	0.18
13	601985	中国核电	122,580.00	0.05
14	603658	安图生物	59,060.00	0.02
15	300458	全志科技	47,915.00	0.02
16	603336	宏辉果蔬	46,310.00	0.02
17	300433	蓝思科技	41,880.00	0.02
18	600977	中国电影	38,920.00	0.02
19	002776	柏堡龙	32,560.00	0.01
20	603789	星光农机	28,320.00	0.01

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	36,280.00
卖出股票收入（成交）总额	22,733,338.01

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,497,000.00	6.35
	其中：政策性金融债	9,497,000.00	6.35
4	企业债券	100,542,855.00	67.20
5	企业短期融资券	10,014,000.00	6.69
6	中期票据	10,119,000.00	6.76
7	可转债（可交换债）	21,173,965.34	14.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	151,346,820.34	101.16

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	101453022	14 五矿股 MTN001	100,000	10,119,000.00	6.76
2	122207	12 骆驼集	100,000	10,116,000.00	6.76
3	122155	12 天富债	100,000	10,033,000.00	6.71
4	011697036	16 兖州煤业 SCP009	100,000	10,014,000.00	6.69
5	122494	15 华夏 05	100,000	10,004,000.00	6.69

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	15,328.88
2	应收证券清算款	2,768,925.65
3	应收股利	-
4	应收利息	1,511,481.18
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,295,735.71

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	113008	电气转债	9,450,773.70	6.32
2	110034	九州转债	2,291,440.50	1.53
3	128009	歌尔转债	2,244,412.80	1.50
4	110032	三一转债	2,242,450.80	1.50
5	123001	蓝标转债	1,505,198.66	1.01
6	128010	顺昌转债	1,498,930.38	1.00
7	113010	江南转债	433,200.00	0.29

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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	2,488	61,495.66	10,040,099.09	6.56%	142,961,093.84	93.44%
南方永利1年定期开放债券（LOF）C	174	31,193.07	0.00	0.00%	5,427,593.79	100.00%
合计	2,662	59,514.95	10,040,099.09	6.34%	148,388,687.63	93.66%

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	李国华	333,000.00	6.45%

2	谷洪宇	260,300.00	5.04%
3	肖唯物	234,300.00	4.54%
4	杨涛	220,000.00	4.26%
5	陈凡	195,300.00	3.78%
6	陈萌萌	164,300.00	3.18%
7	陈学俊	120,000.00	2.32%
8	胡黎明	118,000.00	2.28%
9	杨凯	117,600.00	2.28%
10	贾俊磊	113,800.00	2.20%

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	0.2849%
	南方永利 1 年定期 开放债券 (LOF) C	0.00	0.0000%
	合计	435,871.67	0.2751%

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

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理均未持有本基金 A 类和 C 类份额。

§ 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	245,300,952.07	9,394,349.46
本报告期基金总申购份额	2,149,070.72	204,372.89
减:本报告期基金总赎回份额	94,448,829.86	4,171,128.56
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	153,001,192.93	5,427,593.79

§ 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七届董事会第一次会议审议通过，并按规定向中国证券监督管理委员会深圳监管局备案，基金管理人于2016年10月20日发布公告，自2016年10月18日起，张海波先生担任本基金管理人董事长，吴万善先生不再担任本基金管理人董事长。

基金管理人于2016年10月20日发布公告，南方基金管理有限公司（以下简称“公司”）第六届董事会任期届满，根据《公司法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等法律法规和《公司章程》的规定，公司股东会2016年第一次临时会议选举产生了公司第七届董事会。

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第二十八次会议审议通过，并按规定向中国证券投资基金业协会报备，基金管理人于2016年10月19日发布公告，自2016年10月17日起，郑文祥先生不再担任本基金管理人副总经理。

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4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	
华泰证券	1	12,771,783.94	56.18%	5,330.17	36.99%	-
银河证券	1	9,961,554.07	43.82%	9,078.16	63.01%	-

注：1、为节约交易单元资源，我公司在交易所交易系统升级的基础上，对同一银行托管基金进行了席位整合。

2、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。

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
华泰证券	148,502,899.39	20.98%	1,318,000,000.00	6.81%	-	-
银河证券	559,255,477.60	79.02%	18,031,000,000.00	93.19%	-	-