

南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方稳利1年定期开放债券	
场内简称	南方稳利	
基金主代码	000086	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年7月23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	8,183,001,124.70份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	南方稳利1年定期开放债券A	南方稳利1年定期开放债券C

下属分级基金的交易代码:	000086	000720
报告期末下属分级基金的份额总额	7,973,002,553.39份	209,998,571.31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“南方稳利”。

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，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	一年期定期存款税后收益率×140%
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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年		2015年		2014年	
	南方稳利1年定期开放债券A	南方稳利1年定期开放债券C	南方稳利1年定期开放债券A	南方稳利1年定期开放债券C	南方稳利1年定期开放债券A	南方稳利1年定期开放债券C
本期已实现收益	97,941,230.61	3,423,437.75	190,784,595.99	8,247,697.81	115,156,397.65	2,629,242.37
本期利润	-195,811,829.06	-4,428,624.37	219,860,332.25	9,413,476.00	130,833,618.59	2,695,343.15
加权平均基金份额本期利润	-0.0569	-0.0422	0.0905	0.0836	0.0475	0.0206
本期基金份额净值增长率	2.16%	1.87%	9.71%	9.17%	10.78%	1.86%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
	南方稳利1年定期开放债券A	南方稳利1年定期开放债券C	南方稳利1年定期开放债券A	南方稳利1年定期开放债券C	南方稳利1年定期开放债券A	南方稳利1年定期开放债券C
期末可供分配基金份额利润	-0.0088	-0.0118	0.0180	0.0173	0.0176	0.0175
期末基金资产净值	7,902,496,360.46	207,524,002.59	1,654,444,721.77	64,499,612.03	3,061,618,791.12	146,689,992.62
期末基金份额净值	0.991	0.988	1.038	1.034	1.021	1.018

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数

(为期末余额, 不是当期发生数)。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方稳利1年定期开放债券A

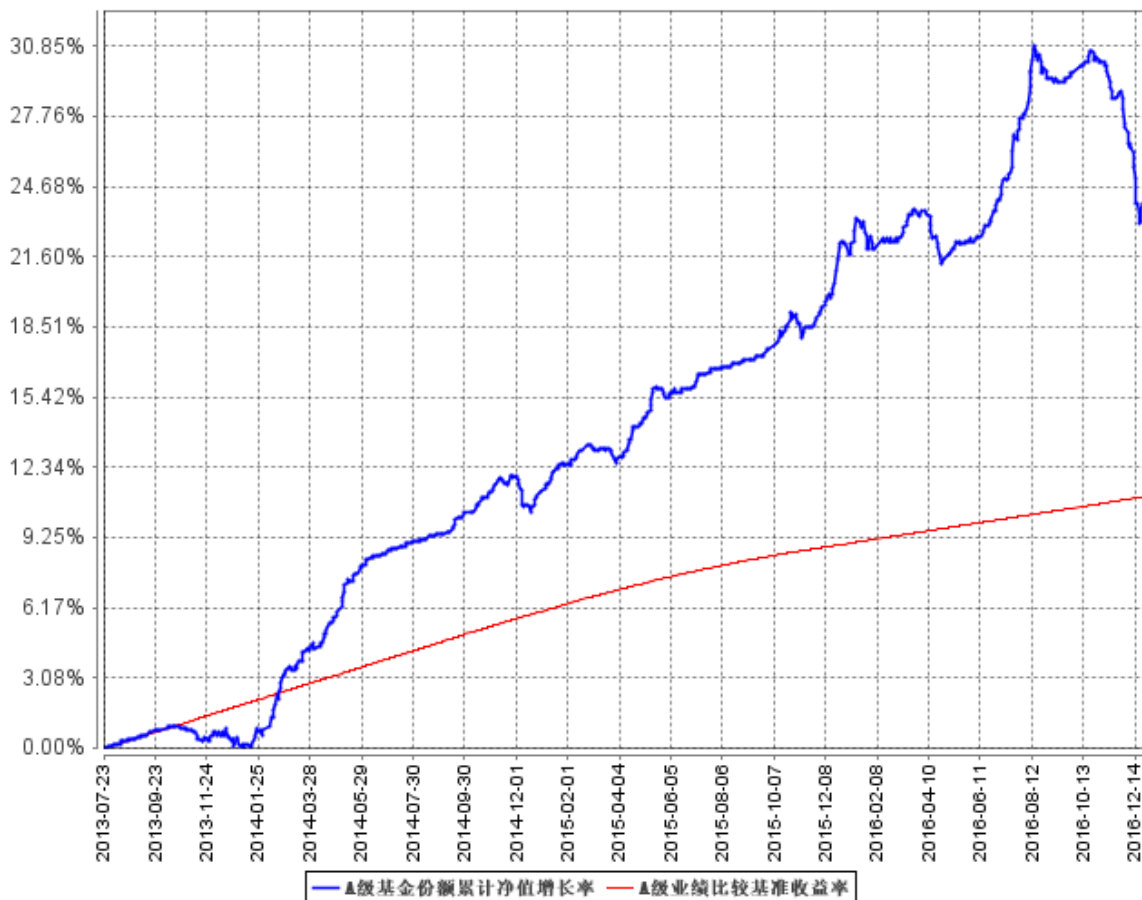
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.74%	0.22%	0.48%	0.01%	-4.22%	0.21%
过去六个月	0.77%	0.21%	0.96%	0.01%	-0.19%	0.20%
过去一年	2.16%	0.18%	1.93%	0.01%	0.23%	0.17%
过去三年	24.17%	0.14%	9.06%	0.01%	15.11%	0.13%
自基金合同生效起至今	24.79%	0.13%	11.09%	0.01%	13.70%	0.12%

南方稳利1年定期开放债券C

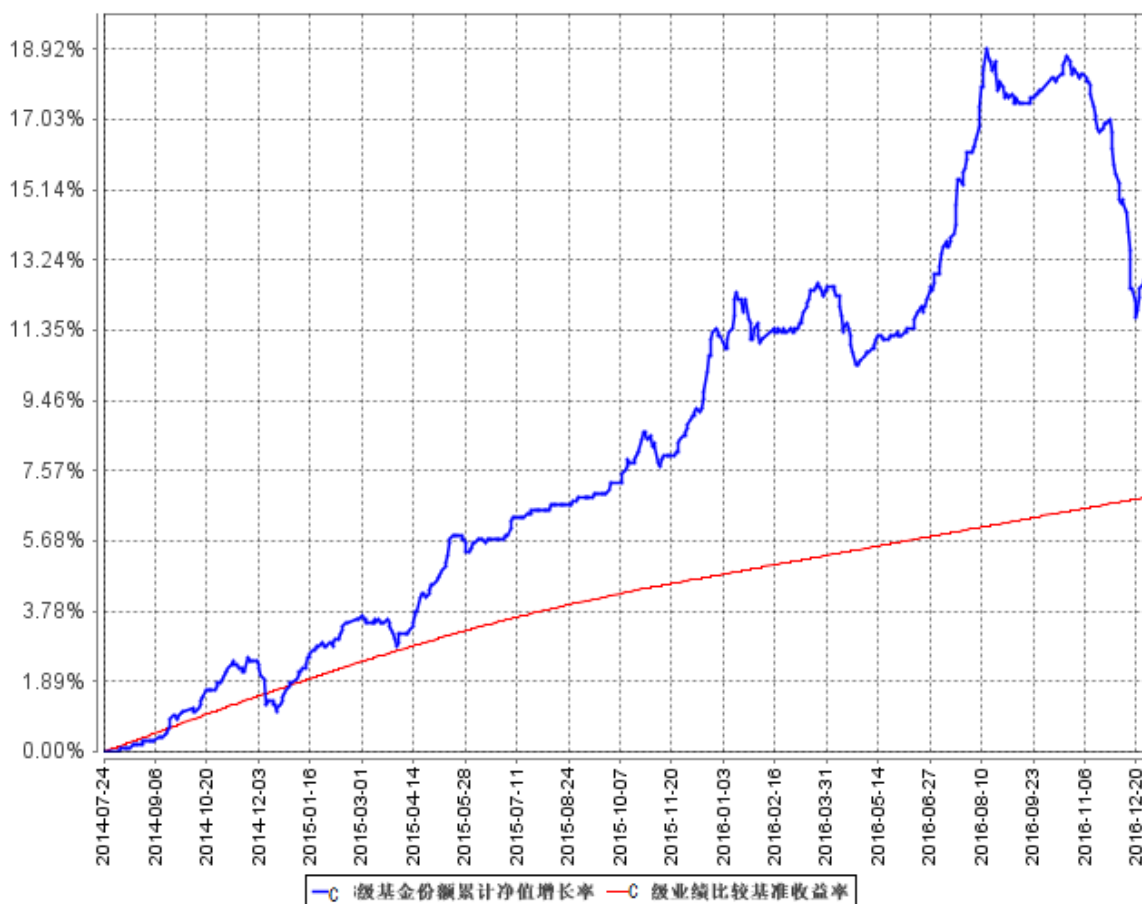
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.85%	0.21%	0.49%	0.01%	-4.35%	0.20%
过去六个月	0.58%	0.21%	0.98%	0.01%	-0.42%	0.20%
过去一年	1.87%	0.18%	1.97%	0.01%	-0.10%	0.17%
自基金合同生效起至今	13.28%	0.14%	8.77%	0.01%	4.51%	0.13%

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

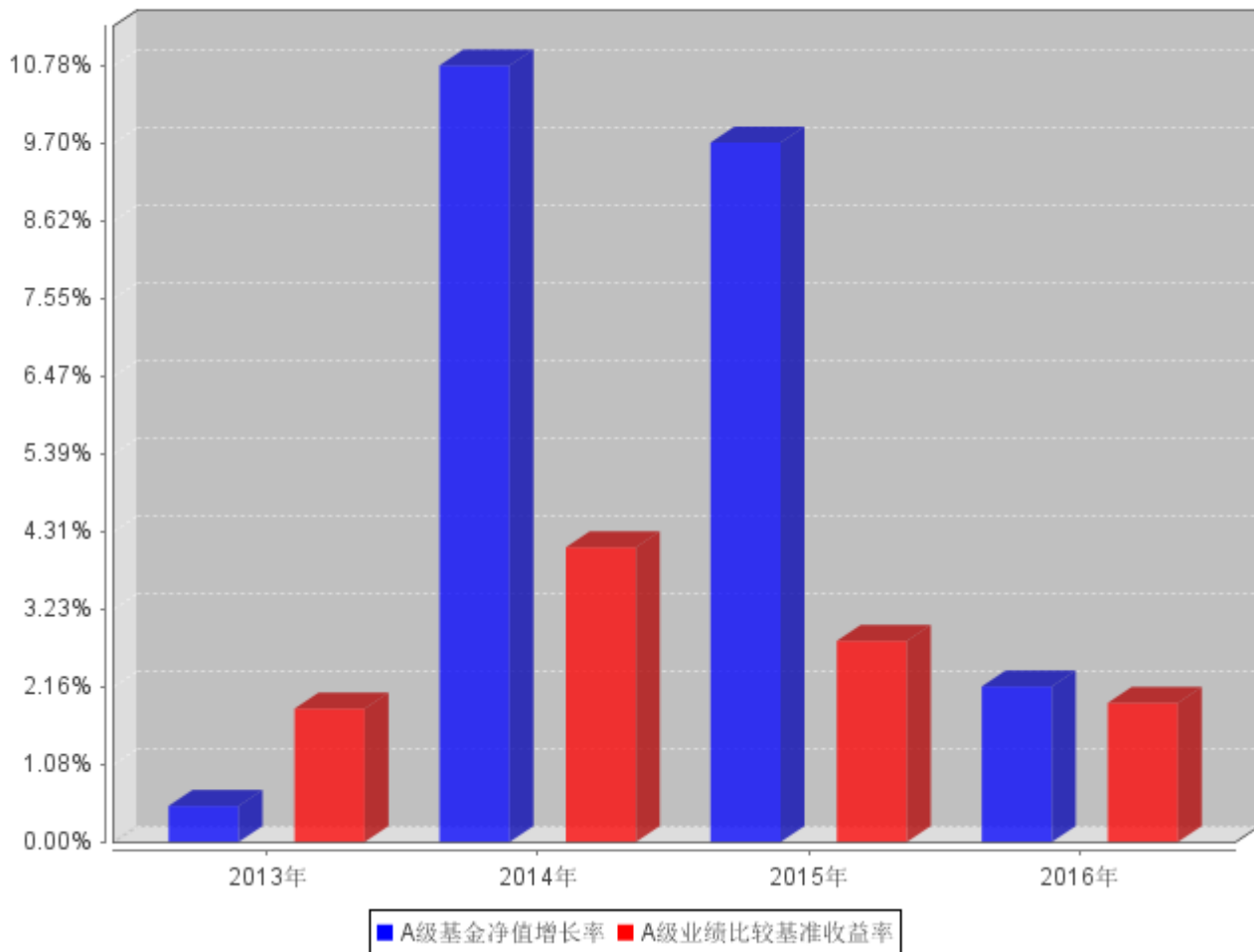


注：1. 本基金的基金合同生效日为 2013 年 7 月 23 日。本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

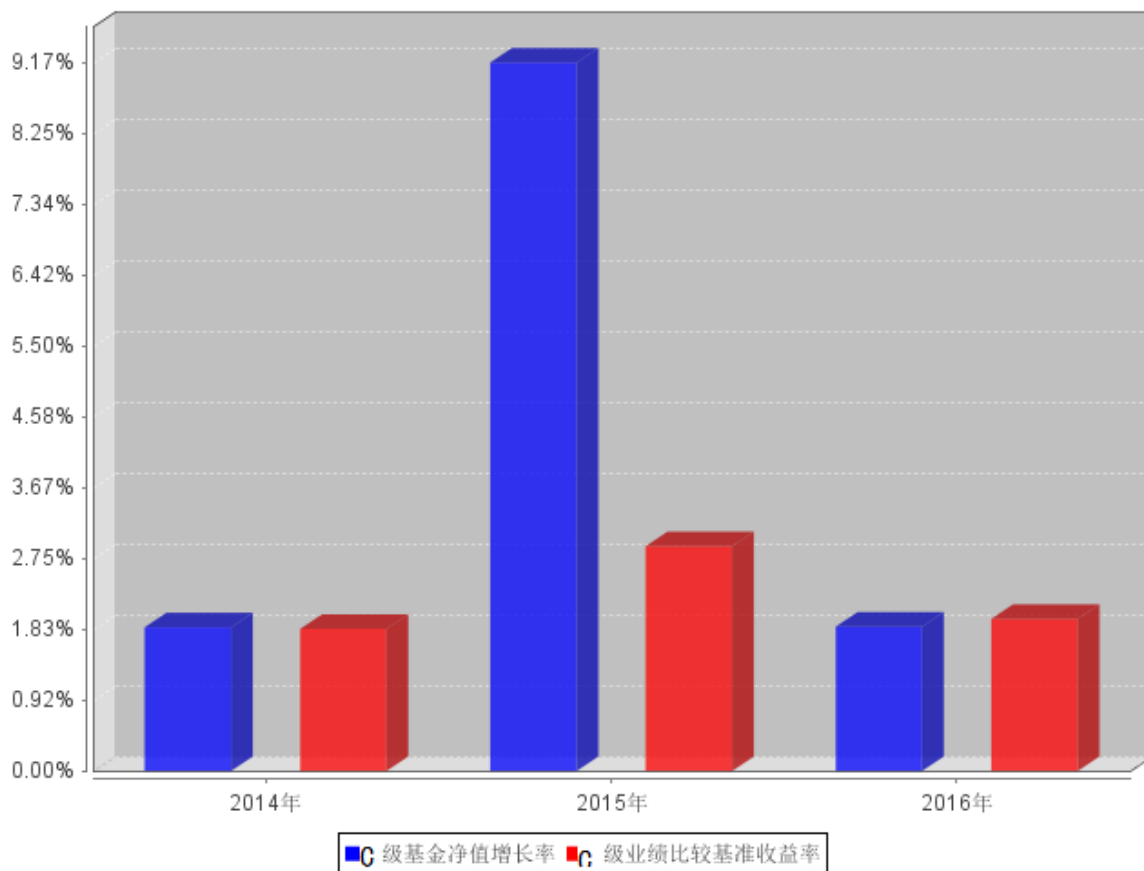
2. 本基金自 2014 年 7 月 24 日起增加 C 类收费模式，原有收费模式称为 A 类。

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

南方稳利1年定期开放债券 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	0.7000	212,495,351.53	14,893,121.65	227,388,473.18	
2015	0.7860	175,018,752.66	12,365,418.73	187,384,171.39	
2014	0.9000	112,692,359.47	4,580,224.48	117,272,583.95	
合计	2.3860	500,206,463.66	31,838,764.86	532,045,228.52	

单位：人民币元

南方稳利1年定期开放债券 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	0.6600	5,961,301.80	505,433.10	6,466,734.90	
2015	0.7410	7,830,359.48	427,708.00	8,258,067.48	
2014	0.2000	2,803,172.71	81,260.83	2,884,433.54	
合计	1.6010	16,594,833.99	1,014,401.93	17,609,235.92	

§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		
杜才超	本基金基金经理	2016年12月9日	-	4年	中央财经大学金融学硕士，具有基金从业资格。2012年7月加入南方基金，历任债券交易员、债券研究员、信用分析师。2016年3月至2016年12月，任南方润元、南方稳利、南方多利、南方金利的基金经理助理。2016年12月至今，任南方丰元、南方润元、南方稳利、南方宣利基金经理。

李璇	本基金基金经理	2013年7月23日	-	9年	女，清华大学金融学学士、硕士，注册金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2007年加入南方基金，担任信用债高级分析师，现任固定收益部副总监、FOF投资决策委员会、社保理事会委托产品投资决策委员会委员、固定收益投资决策委员会委员。2010年9月至2012年6月，担任南方宝元基金经理；2012年12月至2014年9月，担任南方安心基金经理；2010年9月至今，担任南方多利基金经理；2012年5月至今，担任南方金利基金经理；2013年7月至今，担任南方稳利基金经理；2015年12月至今，担任南方润元基金经理；2016年8月至今，担任南方通利、南方丰元、南方荣冠基金经理；2016年9月至今，担任南方多元基金经理；2016年11月至今，任南方荣安基金经理；2016年12月至今，任南方睿见混合基金经理。
杜才超	本基金基金经理助理	2016年3月18日	2016年12月9日	4年	中央财经大学金融学硕士，具有基金从业资格。2012年7月加入南方基金，历任债券交易员、债券研究员、信用分析师。2016年3月至今，任南方润元、南方稳利、南方多利、南方金利的基金经理助理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、

投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、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

海外方面，美国经济复苏相对稳健，美联储12月议息会议宣布加息，符合市场预期，但议息会议上美联储预期2017年加息3次，高于市场之前预期的2次。欧央行延长QE时间至2017年12月，每月购债600亿欧元，认为通缩风险下降，仍有宽松姿态但态度不明确。日元贬值，通胀回升，利率有上行压力，但日央行仍维持10年期利率0%的目标。全球经济数据在2016年底有所好转，全球货币政策逐步转向，全球主要经济体债市收益率出现上行。国内方面，经济全年弱势企稳保持“L”型，GDP增速稳定于6.7%，工业增加值增速稳定于6.2左右。通胀

方面，CPI 保持温和走势，全年上涨 2.0%，PPI 全年上涨-1.4%。

政策方面，货币政策稳健中性，全年未降息，仅有一次降准，央行主要采用公开市场操作、MLF 等提供流动性。8 月央行重启 14 天逆回购，标志着金融去杠杆提速，货币政策转向实质性偏紧，短端资金面中枢上升且波动加大。本年人民币正式纳入 SDR，人民币兑美元出现明显贬值。本年央行继续部署完善宏观审慎政策框架，加强防范系统性风险。

市场方面，全年债市由牛市转为熊市。前三季度，在长期经济增长预期和资金配置压力的共同作用下走出了一轮结构性牛市行情，表现为信用利差和期限利差大幅压缩。其中 10 年期利率债收益率在 4 月、8 月出现一定的调整后再次下行。但进入四季度，全球通胀预期上升且受制于金融去杠杆和人民币贬值压力，货币政策转向实质性偏紧，债市出现剧烈调整，结束了此前连续两年的大牛市，利率曲线陡峭化，信用债上行幅度大于利率债。

投资运作上，南方稳利 1 年定期开放基金全年持仓仍然以信用债为主，同时配有一定的利率债仓位进行波段操作。一季度我们认为在短端公开市场利率不动的背景下长端利率债大幅下行空间有限，因此在大幅降低了组合利率债的久期及仓位。过 4 月份的调整，我们认为市场风险得到一定程度释放，因此在 5 月市场低点逐步增持信用债，同时在 6 月下旬增加了长期利率债的配置，组合久期有所提高，在此期间获得一定的资本利得和票息收益。7-8 月，组合保持了较高的债券仓位，在 7-8 月份的债券小牛市中获取了较好的资本利得和票息收益。10 月之后随着基金重回封闭期，考虑到资金面逐渐趋紧，从 11 月份开始我们逐步降低仓位和久期，但由于市场调整过快，仍导致基金在 11-12 月份债市大跌中出现一定程度的回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期南方稳利 1 年定期开放 A 级基金净值增长率为 2.16%，同期业绩比较基准增长率为 1.93%；南方稳利 1 年定期开放 C 级基金净值增长率为 1.87%，同期业绩比较基准增长率为 1.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，经济层面，主要拖累来自于房地产，基建能否完全对冲地产、汽车的下滑仍有疑问，预计 17 年经济实际增速仍有一定的下行压力，但名义增速回升，对债市不利。通胀方面，PPI 可能进一步向 CPI 传导，预计全年 CPI 均值 2.4%，较 16 年有所上升，预计 17 年 PPI 均值 4.4%，其中一季度达到 5%-6%。政策层面，年后贬值压力将再次大幅上升，叠加春节前传统的资金紧张，预计短期内流动性将持续紧张，此外，控制资产泡沫、控制金融杠杆和通胀水平抬升也将制约货币政策空间，预计货币政策实质性偏紧，难以看到降准和降息操作，财政政策则以托底需求为主，并非强力刺激。总体而言，一季度债券市场仍处于不太有利的环境当中，建议多看

少动，密切观察经济基本面和人民币汇率情况。同时，最近信用事件再次频繁爆发，仍需要严防信用风险，加强对于持仓债券的跟踪和梳理。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展情况，围绕重合规守底线、抓规范促发展，坚持从保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，积极推动主动合规风控管理，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况，不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，并开展了互联网金融相关业务风险自查、信息技术专项自查等多项内控自查工作，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，推动公司合规、内控体系的健全完善；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，持续完善投资合规风控制度流程和系统，积极配合各类新产品、新业务，重点加强内幕交易防控以及对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，有效确保投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织了多项法律法规、职业道德培训以及合规考试，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促落实销售适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；深入贯彻风险为本的反洗钱工作原则，优化反洗钱资源配置，加大反洗钱投入力度，购置外部专业机构制裁名单数据库，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、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。若本基金每个封闭期结束日（不含）之前的第15个工作日当日收市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0.1元（含），则本基金在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收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的50%。若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利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；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3个月后，若本基金每个封闭期结束日（不含）之前的第15个工作日当日收市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0.1元（含），则本基金在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收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的50%。

本报告期内，本基金于2016年3月4日进行了收益分配（A类、C类每10份基金份额均派发红利0.20元）；本基金于2016年6月2日进行了收益分配（A类每10份基金份额均派发红利0.07元，C类每10份基金份额均派发红利0.06元）；本基金于2016年9月1日进行了收益分配（A类每10份基金份额均派发红利0.25元，C类每10份基金份额均派发红利0.24元）；本基金于2016年12月12日进行了收益分配（A类每10份基金份额均派发红利0.18元，C类每10份基金份额均派发红利0.16元）。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，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12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，南方基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§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 21464 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：南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	51,104,230.27	1,328,154.95
结算备付金	107,576,575.77	8,075,594.82
存出保证金	348,641.54	26,319.55
交易性金融资产	10,306,674,007.13	2,427,120,361.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	10,306,674,007.13	2,427,120,361.00
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	757,150,895.73	-
应收证券清算款	-	2,999,412.02
应收利息	182,237,757.17	25,066,285.01
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-

其他资产	-	-
资产总计	11,405,092,107.61	2,464,616,127.35
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	3,237,575,860.49	740,999,452.50
应付证券清算款	49,695,913.95	3,090,604.61
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	4,897,872.19	1,023,041.74
应付托管费	1,399,392.06	292,297.64
应付销售服务费	71,684.63	21,836.26
应付交易费用	75,061.87	25,174.68
应交税费	-	-
应付利息	1,064,959.37	37,386.12
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	291,000.00	182,000.00
负债合计	3,295,071,744.56	745,671,793.55
所有者权益:		
实收基金	8,183,001,124.70	1,656,994,459.11
未分配利润	-72,980,761.65	61,949,874.69
所有者权益合计	8,110,020,363.05	1,718,944,333.80
负债和所有者权益总计	11,405,092,107.61	2,464,616,127.35

注：报告截止日2016年12月31日，基金份额总额8,183,001,124.70份，其中A类基金份额总额为7,973,002,553.39份，基金份额净值0.991元；C类基金份额总额为209,998,571.31份，基金份额净值0.988元。

7.2 利润表

会计主体：南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
一、收入	-138,214,246.48	259,788,181.71
1.利息收入	200,323,559.19	131,289,527.98
其中：存款利息收入	6,065,703.31	11,125,877.07
债券利息收入	179,511,437.89	118,196,418.98
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	14,746,417.99	1,967,231.93
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-39,275,106.11	95,846,873.41
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-39,275,106.11	95,846,873.41
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-301,605,121.79	30,241,514.45
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,342,422.23	2,410,265.87

减：二、费用	62,026,206.95	30,514,373.46
1. 管理人报酬	25,677,663.93	18,329,413.35
2. 托管费	7,336,475.36	5,236,975.23
3. 销售服务费	432,469.56	461,561.99
4. 交易费用	170,937.50	60,953.35
5. 利息支出	27,826,431.46	5,942,926.11
其中：卖出回购金融资产支出	27,826,431.46	5,942,926.11
6. 其他费用	582,229.14	482,543.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-200,240,453.43	229,273,808.25
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-200,240,453.43	229,273,808.25

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,656,994,459.11	61,949,874.69	1,718,944,333.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-200,240,453.43	-200,240,453.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	6,526,006,665.59	299,165,025.17	6,825,171,690.76

(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	7,116,182,449.64	319,151,542.89	7,435,333,992.53
2. 基金赎回款	-590,175,784.05	-19,986,517.72	-610,162,301.77
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)	-	-233,855,208.08	-233,855,208.08
五、期末所有者权益(基金净值)	8,183,001,124.70	-72,980,761.65	8,110,020,363.05
项目	上年度可比期间		
	2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,143,734,242.03	64,574,541.71	3,208,308,783.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	229,273,808.25	229,273,808.25
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)	-1,486,739,782.92	-36,256,236.40	-1,522,996,019.32
其中: 1. 基金申购款	924,812,297.38	24,951,849.70	949,764,147.08
2. 基金赎回款	-2,411,552,080.30	-61,208,086.10	-2,472,760,166.40
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)	-	-195,642,238.87	-195,642,238.87

五、期末所有者权益 (基金净值)	1,656,994,459.11	61,949,874.69	1,718,944,333.80
---------------------	------------------	---------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 杨小松	_____ 徐超	_____ 徐超
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“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

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股票交易。

7.4.4.1.2 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。

7.4.4.1.3 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	-8,331.57	63.38%	-22,257.84	75.79%
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	-1,381.72	79.50%	-13,926.27	85.84%

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。

7.4.4.2 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	25,677,663.93	18,329,413.35
其中：支付销售机构的客户维护费	8,803,415.95	7,998,788.46

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 × 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	7,336,475.36	5,236,975.23

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0.2%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		
	南方稳利1年定期 开放债券A	南方稳利1年定期 开放债券C	合计
中国农业银行	-	59,331.66	59,331.66
南方基金	-	8,199.14	8,199.14
华泰证券	-	111.39	111.39
兴业证券	-	71.68	71.68
合计	-	67,713.87	67,713.87
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		
	南方稳利1年定期 开放债券A	南方稳利1年定期 开放债券C	合计
中国农业银行	-	113,249.29	113,249.29
南方基金	-	7,535.91	7,535.91
华泰证券	-	21.90	21.90
兴业证券	-	5.27	5.27
合计	-	120,812.37	120,812.37

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

单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场 交易的 各关联方名 称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支出
中国农业银行	50,132,388.04	-	-	-	5,070,742,000.00	626,702.10
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场 交易的 各关联方名 称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支出
中国农业银行	224,992,808.33	-	-	-	4,977,536,412.99	441,678.54

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 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	
	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	51,104,230.27	206,699.41	1,328,154.95

注：本基金的银行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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

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

南方稳利1年定期开放债券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	2016 年 12月 12日	2016 年 12月 12日	2016 年 12月 12日	0.1800	138,027,827.84	6,976,465.46	145,004,293.30	
2	2016 年9月 1日	2016 年9月 1日	2016 年9月 1日	0.2500	35,397,314.11	3,982,119.55	39,379,433.66	
3	2016 年6月 2日	2016 年6月 2日	2016 年6月 2日	0.0700	10,008,542.88	1,103,616.11	11,112,158.99	
4	2016 年3月 4日	2016 年3月 4日	2016 年3月 4日	0.2000	29,061,666.70	2,830,920.53	31,892,587.23	
合 计	-	-	-	0.7000	212,495,351.53	14,893,121.65	227,388,473.18	

南方稳利1年定期开放债券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 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	2016年 12月 12日	2016年 12月 12日	2016年 12月 12日	0.1600	3,160,477.10	241,218.84	3,401,695.94	
2	2016年 9月1日	2016年 9月 1日	2016年 9月1日	0.2400	1,336,709.10	108,093.89	1,444,802.99	
3	2016年 6月2日	2016年 6月 2日	2016年 6月2日	0.0600	336,115.77	36,876.64	372,992.41	
4	2016年 3月4日	2016年 3月 4日	2016年 3月4日	0.2000	1,127,999.83	119,243.73	1,247,243.56	
合计	-	-		0.6600	5,961,301.50	505,433.10	6,466,734.90	

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
112491	16宝新02	2016年 12月 13日	-	新债未上市	100.00	100.00	410,000	41,000,000.00	41,000,000.00	-

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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**

截至本报告期末2016年12月31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1,266,323,860.49元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101655021	16 大连万达 MTN003	2017年1月4日	98.05	2,892,000	283,560,600.00
160409	16 农发 09	2017年1月3日	98.84	2,235,000	220,907,400.00
101653006	16 冀中能源 MTN001	2017年1月4日	100.96	2,041,000	206,059,360.00
101655022	16 沙钢 MTN002	2017年1月4日	97.46	1,800,000	175,428,000.00
101660033	16 晋焦煤 MTN001	2017年1月 10日	103.13	1,400,000	144,382,000.00
101453008	14 鲁能源 MTN001	2017年1月3日	103.67	1,000,000	103,670,000.00
101354020	13 宜化 MTN002	2017年1月4日	103.92	508,000	52,791,360.00
011698584	16 中材水泥 SCP002	2017年1月3日	99.33	500,000	49,665,000.00
011698527	16 冀中能源 SCP003	2017年1月3日	99.87	422,000	42,145,140.00
101456039	14 天业 MTN001	2017年1月4日	103.57	400,000	41,428,000.00
041654066	16 华鲁控股 CP001	2017年1月3日	99.17	27,000	2,677,590.00
合计				13,225,000	1,322,714,450.00

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 1,971,252,000.00 元，于 2017 年 1 月 13 日前先后到期。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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	10,306,674,007.13	90.37
	其中：债券	10,306,674,007.13	90.37
	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	757,150,895.73	6.64
	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	158,680,806.04	1.39
7	其他各项资产	182,586,398.71	1.60
8	合计	11,405,092,107.61	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

注：本基金报告期末未持有股票。

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所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

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

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

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	68,396,828.10	0.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,729,680,000.00	21.33
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	3,493,678,179.03	43.08
5	企业短期融资券	836,974,000.00	10.32
6	中期票据	4,098,425,000.00	50.54
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	79,520,000.00	0.98
10	合计	10,306,674,007.13	127.09

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	160409	16 农发 09	7,900,000	780,836,000.00	9.63
2	160410	16 农发 10	4,600,000	449,742,000.00	5.55
3	136090	15 绿地 02	4,225,000	410,458,750.00	5.06
4	160205	16 国开 05	3,800,000	369,892,000.00	4.56
5	101651052	16 大连万达 MTN004	3,400,000	330,854,000.00	4.08

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	348,641.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	182,237,757.17

5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	182,586,398.71

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

§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
南方稳利1年定期开放债券A	36,693	217,289.47	2,177,212,302.41	27.31%	5,795,790,250.98	72.69%
南方稳利1年定期开放债券C	1,450	144,826.60	-	-	209,998,571.31	100.00%
合计	38,143	214,534.81	2,177,212,302.41	26.61%	6,005,788,822.29	73.39%

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	南方稳利1年定期开 放债券A	169,650.37	0.0021%
	南方稳利1年定期开 放债券C	-	-
	合计	169,650.37	0.0021%

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。

9.3 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：本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方稳利 1 年定期开放 债券 A	南方稳利 1 年定期 开放债券 C
基金合同生效日（2013 年 7 月 23 日） 基金份额总额	855,619,519.69	-
本报告期期初基金份额总额	1,594,632,161.98	62,362,297.13
本报告期基金总申购份额	6,950,724,330.05	165,458,119.59
减:本报告期基金总赎回份额	572,353,938.64	17,821,845.41
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	7,973,002,553.39	209,998,571.31

§ 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

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。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 91,000 元。

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	
国泰君安	1	-	-	-1,436.04	10.92%	-
华泰证券	1	-	-	-8,331.57	63.38%	-
齐鲁证券	1	-	-	-3,377.84	25.70%	-

注：本基金本报告期租用证券公司交易单元情况如下：专用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专用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席位:

(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
国泰君安	1,579,739,541.80	29.09%	-	-	-	-
华泰证券	518,067,162.13	9.54%	10,070,018,000.00	5.63%	-	-
齐鲁证券	3,333,477,841.51	61.38%	168,673,700,000.00	94.37%	-	-