

南方利淘灵活配置混合型证券投资基金 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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

基金名称	南方利淘灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	南方利淘灵活配置混合	
基金主代码	001183	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 4 月 17 日	
基金管理人	南方基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	905,163,826.32 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	南方利淘 A	南方利淘 C
下属分级基金的交易代码:	001183	001504
报告期末下属分级基金的份额总额	891,104,037.19 份	14,059,789.13 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“南方利淘”。

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析及投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析各种金融工具的定价，挖掘定价错配的机会，并据此制定本基金在股票、债券、现金、金融衍生品等资产之间的调整原则、配置比例和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳健增值。
业绩比较基准	人民币三年期定期存款利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、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	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	鲍文革	田东辉
	联系电话	0755-82763888	010-68858113
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话	400-889-8899	95580	
传真	0755-82763889	010-68858120	

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	南方基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路六 号免税商务大厦 31-33 层

§ 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 4 月 17 日 (基金合同生效日) -2015 年 12 月 31 日	
	南方利淘 A	南方利淘 C	南方利淘 A	南方利淘 C
本期已实现收益	40,703,780.56	1,032,025.04	83,112,049.77	1,187,629.12
本期利润	30,871,979.54	-582,022.85	87,726,945.38	1,996,728.37
加权平均基金份额 本期利润	0.0335	-0.0249	0.0416	0.0079
本期加权平均净值 利润率	3.21%	-2.42%	4.08%	0.78%
本期基金份额净值 增长率	4.20%	0.74%	2.40%	0.69%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末	
期末可供分配利润	55,777,341.84	977,617.29	32,288,420.08	3,646,230.57
期末可供分配基金 份额利润	0.0626	0.0695	0.0186	0.0174
期末基金资产净值	950,643,072.13	15,037,406.42	1,780,744,249.81	214,708,308.11
期末基金份额净值	1.067	1.070	1.024	1.023

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. 本基金合同生效日为 2015 年 04 月 17 日, 基金合同生效日至本报告期末, 本基金运作时间已满一年。

5. 本报告期内，C 类份额实际持有的时间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 2 日以及 2016 年 8 月 31 日至 2016 年 12 月 31 日。

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

南方利淘 A

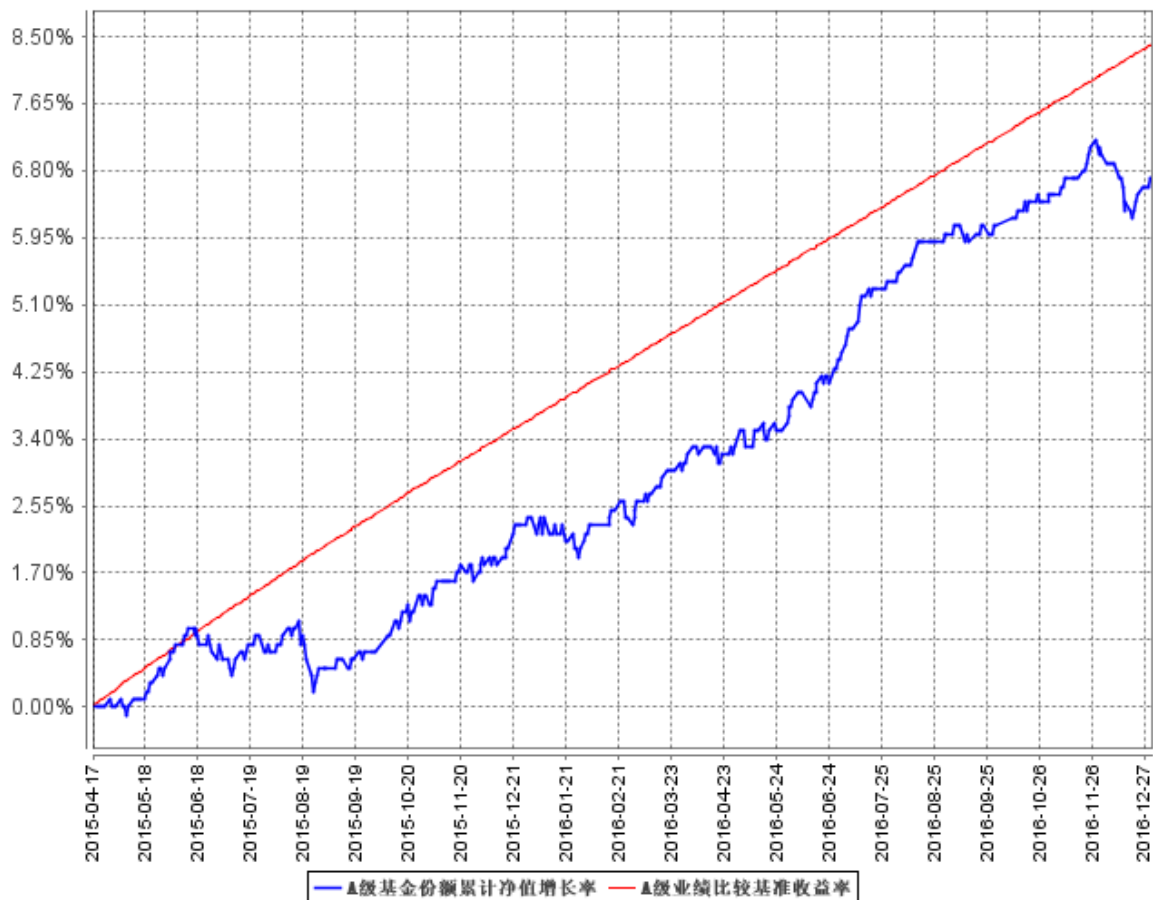
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.57%	0.08%	1.11%	0.02%	-0.54%	0.06%
过去六个月	2.20%	0.07%	2.25%	0.01%	-0.05%	0.06%
过去一年	4.20%	0.08%	4.58%	0.01%	-0.38%	0.07%
自基金合同生效起至今	6.70%	0.08%	8.40%	0.01%	-1.70%	0.07%

南方利淘 C

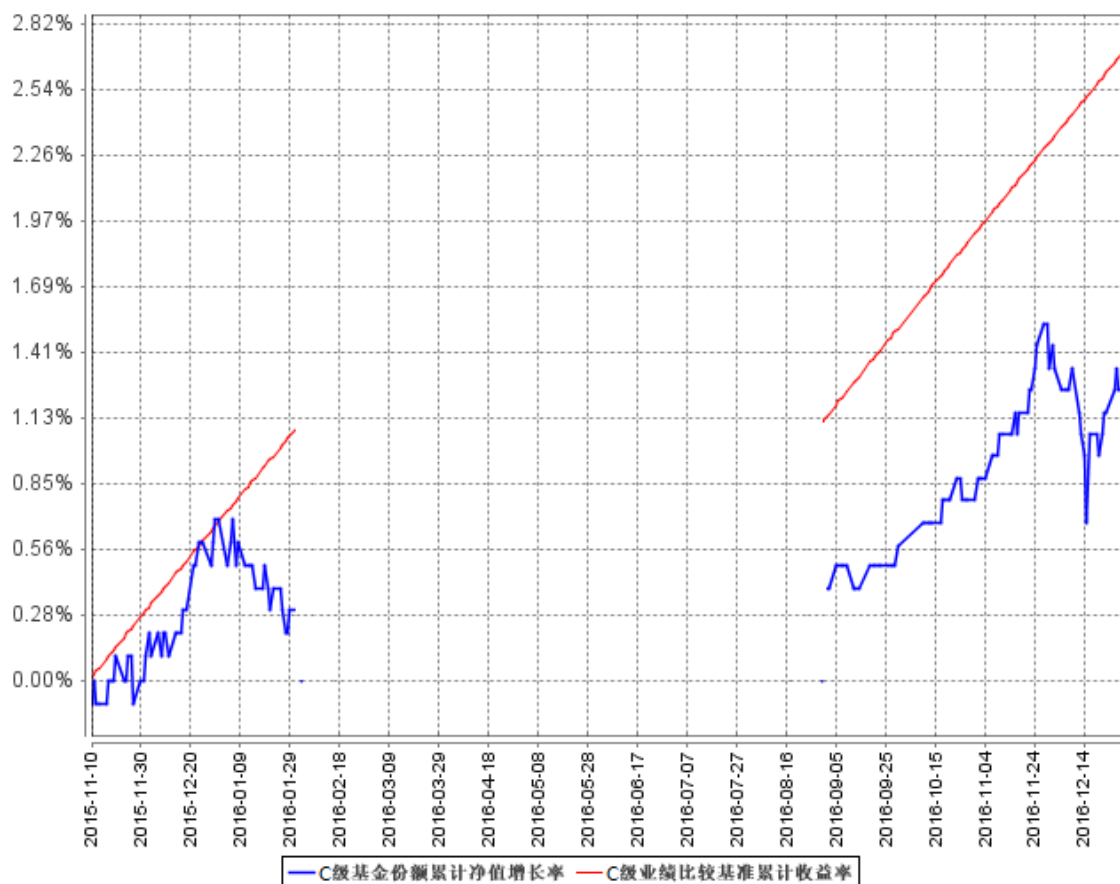
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.85%	0.09%	1.18%	0.02%	-0.33%	0.07%
过去六个月	1.04%	0.08%	1.58%	0.02%	-0.54%	0.06%
过去一年	0.74%	0.09%	2.01%	0.02%	-1.27%	0.07%
自基金合同生效起至今	1.44%	0.09%	2.70%	0.01%	-1.26%	0.08%

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



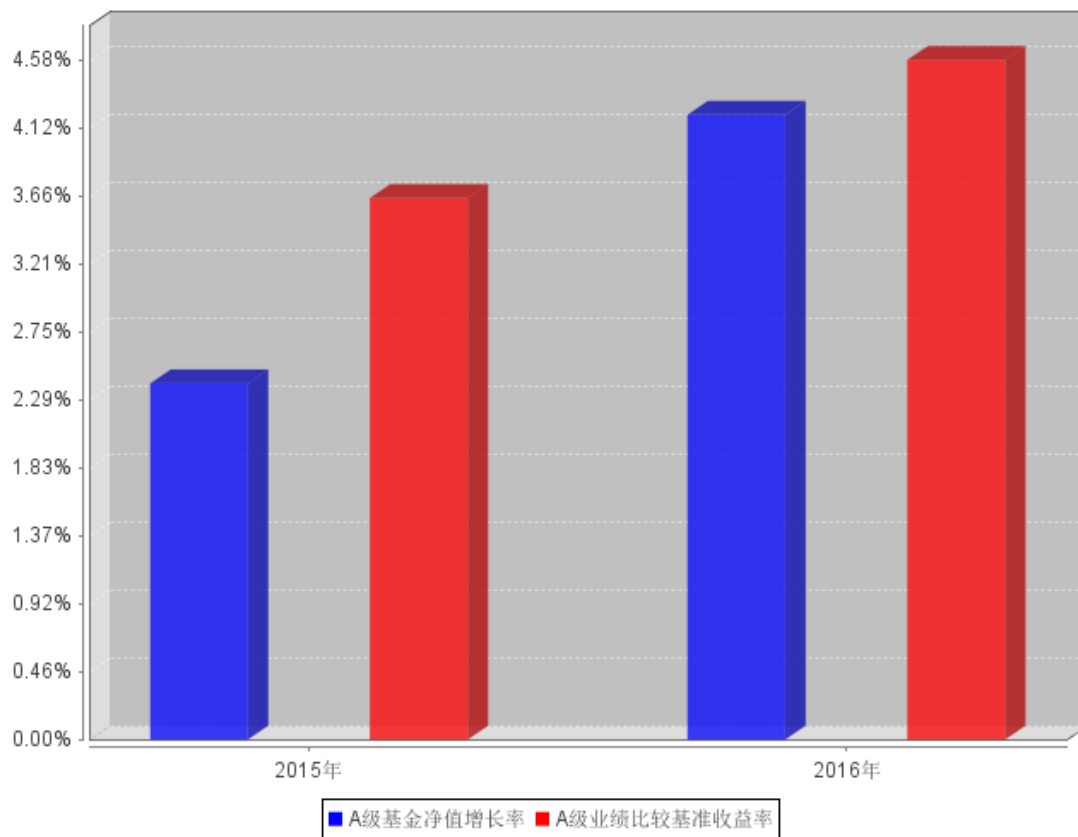
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



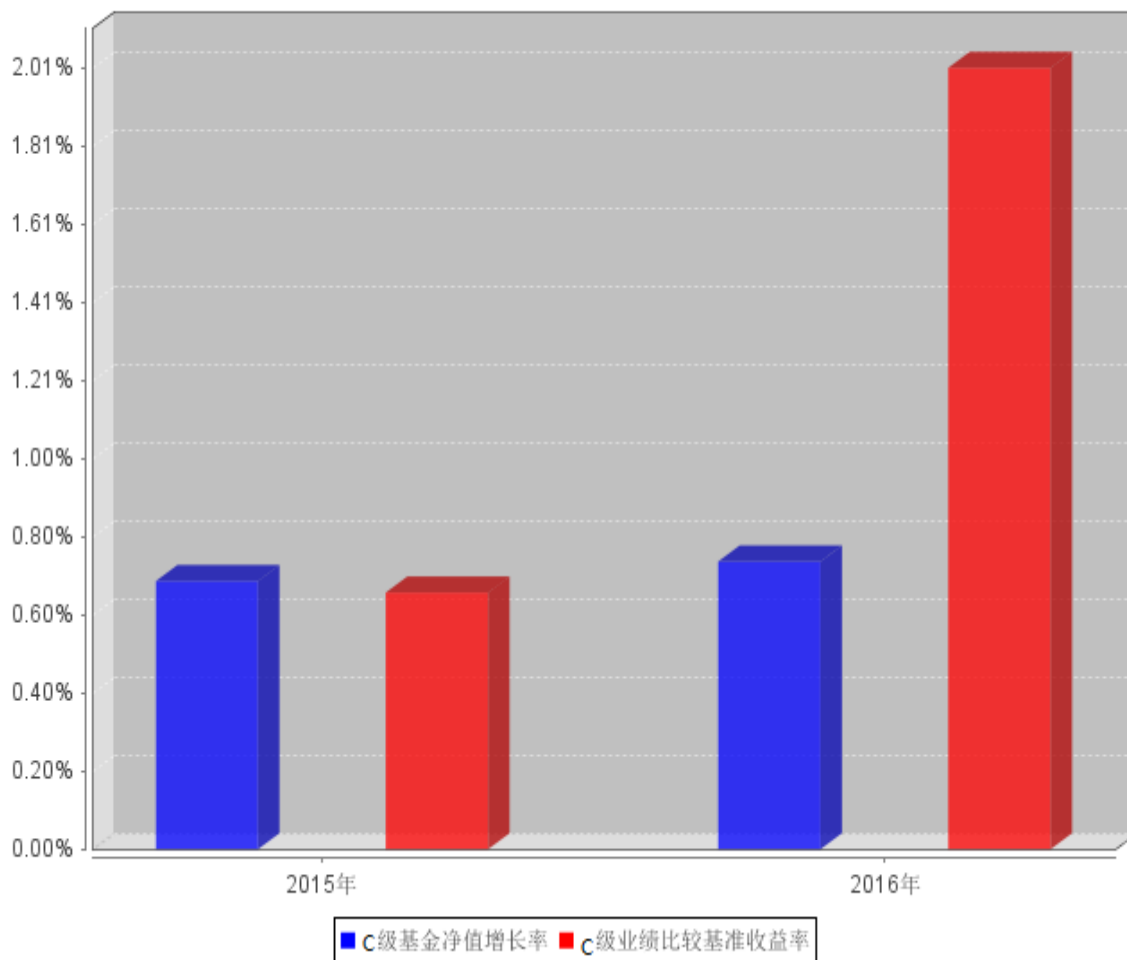
注：本基金建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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：基金合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

§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		
孙鲁闽	本基金 基金经 理	2015 年 4 月 17 日	-	13 年	南开大学理学和经济学双学士、澳大利亚新南威尔士大学商学硕士，具有基金从业资格。曾任职于厦门国际银行福州分行，2003 年 4 月加入南方基金管理有限公司，历任行业研究员、南方高增和南方隆元的基金经理助理、专户投资管理部总监助理，现任投资部副总监；2007 年 12 月至 2010 年 10 月，担任南方基金企业年金和专户的投资经理。2010 年 12 月至今，任南方避险基金经理；2011 年 6 月至今，任南方保本基金经理；2015 年 4 月至今，任南方利淘基金经理；2015 年 5 月至今，任南方利鑫基金经理；2015 年 5 月至今，任南方丰合基金经理；2015 年 12 月至

					今，任南方瑞利保本基金经理；2016 年 1 月至今，任南方益和保本基金经理；2016 年 9 月至今，任南方安泰养老基金经理；2016 年 11 月至今，任南方安裕养老基金经理。
陈乐	本基金基金经理助理	2016 年 2 月 23 日	-	8 年	北京大学金融学硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金，历任研究部研究员、高级研究员，负责交运、有色、煤炭的行业研究；2016 年 2 月至今，任南方避险、南方保本、南方利淘、南方利鑫、南方丰合、南方益和、南方瑞利的基金经理助理；2016 年 10 月至今，任南方安泰养老基金经理助理；2016 年 12 月至今，任南方安裕养老基金经理助理。

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《南方利淘混合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

回顾 2016 年，大类资产表现迥异。工业品在国外产能出清、国内供给侧改革、需求企稳的情况下出现了较大幅度的上涨。英国脱欧、美国大选等黑天鹅事件频发，阶段性推升了贵金属价格。美元处于加息周期中，美元相对强势，人民币经历了一定幅度的贬值。A 股整体表现平稳，由于投资者结构以及政策取向发生了变化，价值股表现突出。国内债券市场收益率在流动性宽松、国外出现负利率的情况下一度触及多年历史低位，但年底在美国利率上升、货币政策转向中性、工业品价格上涨的情况下，债券收益率出现上行，而债券市场普遍存在期限错配、杠杆率高、资产流动性差等问题，因此经历了较大回调。

本基金为新股申购基金。2016 年新股申购规则不断变化，对新股申购底仓的要求持续提升，本基金在保证投资组合稳健性的前提下，随着净值上升，逐步提升了股票仓位。

投资风格上，本基金的核心仓位投向低估值、高分红、具有安全边际的价值股，同时积极寻找具有竞争优势且有真正成长的白马股投资机会。2016 年价值股表现较好，本基金的股票部分相对主要指数取得了一定的超额收益。

本基金在债券配置上尤其重视控制风险，以持有到期为主，主要配置短久期、高流动性、高评级的债券。由于这样的配置策略，本基金的债券部分在二季度风险事件频发、四季度债市收益

率明显上升的环境下，受到的冲击较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年，本基金 A 级净值增长率为 4.20%，C 级净值增长率为 0.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们看好居民对股票的配置需求不断提升。中国居民资产配置中，房地产等实物资产占比 60%，占居民总资产的比重明显偏高。2016 年房地产价格大幅上涨，主要城市相继出台地产调控政策，改善型需求以及投资需求受到抑制。我们认为，在中央将房地产的主要功能定位于居住、严控系统性风险的大背景下，未来居民对于房地产的配置比重不会明显增加，金融资产的比重将会逐步提升。与美国居民资产配置相比，我国居民金融资产配置以存款、理财为主，而美国居民的金融资产则以股票、养老金、共同基金等权益类资产为主，我们预计未来居民资产配置中股票的比重有较大提升空间。

我们看好机构对股票的配置需求不断提升。首先是基本养老金入市带来资金增量。2016 年 12 月，社保基金会评出第一批基本养老保险投资管理机构，基本养老金入市节奏加快。2015 年底全国基本养老保险累计余额接近 4 万亿，基本养老金入市将给股市带来新增资金。其次是保险资金面临再配置压力。近年来保险行业资金运用余额持续高速增长，当前保险行业资金运用余额达到 13 万亿。如果考虑每年的保费收入，以及每年有一部分存量资产（存款、债券等）到期，预计 2017 年将有超过 4 万亿保险资金等待配置。除了基本养老金、保险等机构投资者，A 股纳入 MSCI、深港通开通等拓宽了国外机构投资者投资 A 股的渠道，给 A 股带来新增资金。

我们认为，居民和机构对股票的配置需求都在上升，而股票在大类资产中的性价比相对较高，看好 2017 年股市的表现。受益于机构投资者比重增加，我们认为低估值、优业绩、高分红的股票仍然是优质稀缺资产，看好这类个股的表现。同时我们发现，在过去几年经济下行的背景下，部分行业的竞争格局有了明显的改善，龙头公司的市场占有率提升，竞争优势显著，这类个股也将是我们重点关注的方向。此外，我们相对看好国家政策支持、具备效率提升潜力的国企改革、医改、军工、京津冀等板块，这些板块中的低估值个股具备长期配置价值。

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，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 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人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；若投资人不选择，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。同一类别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。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

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利淘灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，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，南方利淘灵活配置混合型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方利淘灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、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。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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利淘灵活配置混合型证券投资基金 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 21461 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：南方利淘灵活配置混合型证券投资基金

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	2,684,485.56	25,493,546.98
结算备付金	4,604,427.88	5,110,567.69
存出保证金	60,142.14	220,957.69
交易性金融资产	996,902,101.66	1,053,279,923.16
其中：股票投资	61,306,379.36	74,831,451.86
基金投资	-	-
债券投资	935,595,722.30	978,448,471.30
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	-	758,362,577.54
应收证券清算款	1,000,000.00	212,040,919.21
应收利息	12,634,018.66	17,660,079.58
应收股利	-	-
应收申购款	15,634.75	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,017,900,810.65	2,072,168,571.85
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	49,000,000.00	60,000,000.00
应付证券清算款	116,306.34	-
应付赎回款	1,612,539.22	14,014,289.21
应付管理人报酬	832,711.19	1,895,010.65
应付托管费	166,542.25	379,002.13
应付销售服务费	1,901.35	22,060.64
应付交易费用	68,722.34	173,997.36
应交税费	-	-
应付利息	27,984.27	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	393,625.14	231,653.94
负债合计	52,220,332.10	76,716,013.93
所有者权益：		
实收基金	905,163,826.32	1,948,402,195.57
未分配利润	60,516,652.23	47,050,362.35
所有者权益合计	965,680,478.55	1,995,452,557.92
负债和所有者权益总计	1,017,900,810.65	2,072,168,571.85

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 905,163,826.32 份，其中 A 类基金份额总额为 891,104,037.19 份，基金份额净值为 1.067 元；C 类基金份额总额为 14,059,789.13 份，基金份额净值为 1.070 元。

7.2 利润表

会计主体：南方利淘灵活配置混合型证券投资基金

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4月17日(基 金合同生效日)至 2015年12月31日
一、收入	45,664,058.35	129,185,205.52
1.利息收入	26,922,569.27	63,813,857.80
其中：存款利息收入	981,187.67	21,993,433.09
债券利息收入	24,973,075.28	28,051,093.94
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	968,306.32	13,769,330.77
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	28,540,172.53	47,411,828.22
其中：股票投资收益	23,167,394.81	42,107,509.57
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,201,791.31	3,494,496.85
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	1,170,986.41	1,809,821.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-11,445,848.91	5,423,994.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,647,165.46	12,535,524.64
减：二、费用	15,374,101.66	39,461,531.77
1. 管理人报酬	9,937,173.58	30,832,441.46
2. 托管费	1,987,434.74	6,166,488.29

3. 销售服务费	23,218.52	36,947.10
4. 交易费用	473,521.50	912,241.87
5. 利息支出	2,525,353.32	1,194,713.05
其中：卖出回购金融资产支出	2,525,353.32	1,194,713.05
6. 其他费用	427,400.00	318,700.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	30,289,956.69	89,723,673.75
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	30,289,956.69	89,723,673.75

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方利淘灵活配置混合型证券投资基金

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)	1,948,402,195.57	47,050,362.35	1,995,452,557.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,289,956.69	30,289,956.69
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)	-1,043,238,369.25	-16,823,666.81	-1,060,062,036.06
其中：1. 基金申购款	559,707,314.03	29,930,164.57	589,637,478.60

2. 基金赎回款	-1,602,945,683.28	-46,753,831.38	-1,649,699,514.66
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）	905,163,826.32	60,516,652.23	965,680,478.55
项目	上年度可比期间		
	2015年4月17日(基金合同生效日)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）	6,824,828,709.02	-	6,824,828,709.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	89,723,673.75	89,723,673.75
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）	-4,876,426,513.45	-42,673,311.40	-4,919,099,824.85
其中：1. 基金申购款	293,352,403.37	4,339,426.51	297,691,829.88
2. 基金赎回款	-5,169,778,916.82	-47,012,737.91	-5,216,791,654.73
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,948,402,195.57	47,050,362.35	1,995,452,557.92

注：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：

<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

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、注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司(“中国邮政储蓄银行”)	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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

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 4 月 17 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付	9,937,173.58	30,832,441.46

的管理费		
其中：支付销售机构的 客户维护费	1,882,707.08	5,225,279.68

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 1.00% 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 1.00% / 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 4 月 17 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的 托管费	1,987,434.74	6,166,488.29

注：支付基金托管人中国邮政储蓄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 X 0.20% / 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		
	南方利淘 A	南方利淘 C	合计
南方基金	-	23,218.52	23,218.52
合计	-	23,218.52	23,218.52
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 4 月 17 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	南方利淘 A	南方利淘 C	合计
南方基金	-	36,947.10	36,947.10
合计	-	36,947.10	36,947.10

注：自 2015 年 4 月 17 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日，支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.50%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。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 0.50%/ 当年天数。

根据《南方基金关于旗下部分基金销售服务费优惠的公告》和《南方基金关于继续开展旗下部分基金销售服务费优惠的公告》，自 2015 年 6 月 25 日起，销售服务费率调整为 0.10%，调整后，本基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.10%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。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 0.10% / 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 邮政 储蓄 银行	-	-	1,885,200,000.00	145,785.84	-	-
上年度可比期间						

2015 年 4 月 17 日(基金合同生效日)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 邮政 储蓄 银行	99,912,273.77	-	500,000,000.00	16,616.30	440,000,000.00	201,315.88

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 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。

7.4.4.4.2 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

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 4 月 17 日(基金合同生效日) 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
中国邮政储蓄银 行	2,684,485.56	188,303.08	25,493,546.98	6,438,546.22

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，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

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	
002838	道恩	2016	2017	新股未上市	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	

	股份	年 12月 28日	年 1月 6日	上市						
300586	美联 新材	2016 年 12月 26日	2017 年 1月 4日	新股未 上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里 马	2016 年 12月 30日	2017 年 1月 10日	新股未 上市	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000540	中天城投	2016年11月28日	重大资产重组	6.93	2017年1月3日	7.00	100,000	674,000.00	693,000.00	-
600151	航天机电	2016年11月11日	重大资产重组	10.04	-	-	50,000	556,254.00	502,000.00	-

603986	兆易 创新	2016 年 9月 19日	重大 资产 重组	177.97	2017年 3月 13日	195.77	1,133	26,353.58	201,640.01	-
--------	----------	------------------------	----------------	--------	--------------------	--------	-------	-----------	------------	---

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。

7.4.6.3 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 49,000,000.00 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	61,306,379.36	6.02
	其中：股票	61,306,379.36	6.02
2	固定收益投资	935,595,722.30	91.91
	其中：债券	935,595,722.30	91.91
	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	7,288,913.44	0.72
7	其他各项资产	13,709,795.55	1.35
8	合计	1,017,900,810.65	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	-	-
C	制造业	37,368,306.59	3.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	333,500.00	0.03
E	建筑业	3,083,071.02	0.32
F	批发和零售业	5,001,050.00	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	683,400.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	272,634.56	0.03
J	金融业	7,273,617.19	0.75
K	房地产业	3,625,600.00	0.38
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	3,665,200.00	0.38

S	综合	-	-
	合计	61,306,379.36	6.35

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	000333	美的集团	187,632	5,285,593.44	0.55
2	000786	北新建材	380,576	3,916,127.04	0.41
3	601098	中南传媒	220,000	3,665,200.00	0.38
4	601166	兴业银行	224,309	3,620,347.26	0.37
5	000895	双汇发展	165,721	3,468,540.53	0.36
6	600511	国药股份	100,000	3,010,000.00	0.31
7	600266	北京城建	220,000	2,932,600.00	0.30
8	000921	海信科龙	205,800	2,101,218.00	0.22
9	600567	山鹰纸业	550,000	1,991,000.00	0.21
10	600068	葛洲坝	216,301	1,987,806.19	0.21

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	002142	宁波银行	6,159,396.00	0.31
2	000786	北新建材	4,048,342.04	0.20

3	601166	兴业银行	4,037,583.05	0.20
4	002117	东港股份	3,260,346.00	0.16
5	000333	美的集团	2,983,497.00	0.15
6	601169	北京银行	2,920,182.00	0.15
7	601009	南京银行	2,671,778.00	0.13
8	600741	华域汽车	2,367,838.00	0.12
9	000921	海信科龙	2,184,463.00	0.11
10	600273	嘉化能源	2,079,967.87	0.10
11	600266	北京城建	1,995,660.00	0.10
12	600511	国药股份	1,873,252.00	0.09
13	002563	森马服饰	1,839,195.00	0.09
14	603898	好莱客	1,812,800.00	0.09
15	600015	华夏银行	1,799,569.00	0.09
16	000651	格力电器	1,750,620.00	0.09
17	000895	双汇发展	1,739,100.00	0.09
18	002304	洋河股份	1,737,289.00	0.09
19	000858	五粮液	1,709,230.12	0.09
20	600567	山鹰纸业	1,696,763.00	0.09

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	601166	兴业银行	13,801,000.98	0.69
2	000895	双汇发展	11,653,958.40	0.58
3	002142	宁波银行	5,463,570.99	0.27
4	000418	小天鹅A	4,102,394.67	0.21

5	601169	北京银行	3,995,851.89	0.20
6	000001	平安银行	3,441,875.93	0.17
7	000961	中南建设	2,828,263.74	0.14
8	600068	葛洲坝	2,495,548.72	0.13
9	600885	宏发股份	2,428,098.53	0.12
10	601009	南京银行	2,072,851.15	0.10
11	000910	大亚圣象	1,930,833.00	0.10
12	000858	五粮液	1,838,063.20	0.09
13	000333	美的集团	1,741,548.70	0.09
14	601333	广深铁路	1,701,105.00	0.09
15	000488	晨鸣纸业	1,688,514.00	0.08
16	002117	东港股份	1,610,349.00	0.08
17	603508	思维列控	1,581,561.55	0.08
18	000625	长安汽车	1,548,192.00	0.08
19	601229	上海银行	1,535,643.84	0.08
20	601098	中南传媒	1,493,044.00	0.07

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	131,653,152.75
卖出股票收入（成交）总额	165,311,285.51

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	59,963,000.00	6.21
	其中：政策性金融债	59,963,000.00	6.21
4	企业债券	255,734,722.30	26.48
5	企业短期融资券	609,736,000.00	63.14
6	中期票据	10,162,000.00	1.05
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	935,595,722.30	96.88

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	041664027	16 营口港 CP002	500,000	50,125,000.00	5.19
2	011698135	16 鲁商 SCP006	500,000	49,965,000.00	5.17
3	041656018	16 澜沧江 CP001	500,000	49,925,000.00	5.17
4	011699583	16 国电 SCP003	400,000	40,152,000.00	4.16
5	011698246	16 鄂能源 SCP002	400,000	40,072,000.00	4.15

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股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值或期限套利等操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	60,142.14
2	应收证券清算款	1,000,000.00

3	应收股利	-
4	应收利息	12,634,018.66
5	应收申购款	15,634.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,709,795.55

8.12.4 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。

8.12.5 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 利淘 A	8,561	104,088.78	516,232,721.95	57.93%	374,871,315.24	42.07%
南方 利淘 C	1	14,059,789.13	14,059,789.13	100.00%	0.00	0.00%
合计	8,562	105,718.24	530,292,511.08	58.59%	374,871,315.24	41.41%

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	南方利淘 A	1,899,415.73	0.2132%
	南方利淘 C	0.00	0.0000%
	合计	1,899,415.73	0.2098%

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

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	南方利淘 A	0

金投资和研究部门负责人 持有本开放式基金	南方利淘 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	南方利淘 A	>100
	南方利淘 C	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方利淘 A	南方利淘 C
基金合同生效日（2015 年 4 月 17 日）基金 份额总额	6,824,828,709.02	-
本报告期期初基金份额总额	1,738,536,448.53	209,865,747.04
本报告期基金总申购份额	526,858,330.11	32,848,983.92
减:本报告期基金总赎回份额	1,374,290,741.45	228,654,941.83
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	891,104,037.19	14,059,789.13

§ 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)有限公司审计费用 90,000 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 2 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	
中信证券		2290,453,750.18	100.00%	270,500.01	100.00%	-

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。

11.7.2 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
中信证券	278,662,385.50	100.00%	7,383,900,000.00	100.00%	-	-