

# 南方现金通货币市场基金 2017 年年度报 告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 03 月 29 日

## 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 2018 年 3 月 26 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 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	南方现金货币			
基金主代码	000493			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2014 年 1 月 21 日			
基金管理人	南方基金管理股份有限公司			
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	44,261,711,062.30 份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	南方现金货币 A	南方现金货币 B	南方现金货币 C	南方现金货币 E
下属分级基金的交易代码	000493	000494	000495	000719
报告期末下属分级基金的份额总额	7,446,220.75 份	30,188,938.67 份	6,430,198,246.24 份	37,793,877,656.64 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“南方现金通”。

### 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七天通知存款税后利率。
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		南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	常克川	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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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	报告期(2017年01月01日-2017年12月31日)				报告期(2016年01月01日-2016年12月31日)				报告期(2015年01月01日-2015年12月31日)			
	南方现金通货 币 A	南方现金通货 币 B	南方现金通货 币 C	南方现金通货 币 E	南方现金通货 币 A	南方现金通货 币 B	南方现金通货 币 C	南方现金通货 币 E	南方现金通货 币 A	南方现金通货 币 B	南方现金通货 币 C	南方现金通货 币 E
本期已实现收	383,064.65	2,191,099.68	259,971.59	772,050.16	319,410.54	1,390,203.86	30,517,497.71	83,091,354.02	390,429.28	2,011,429.29	19,751,748.77	2,408,709.85

益													
本期 利 润	383,064.65	2,191,099.68	259,971.59	772,050.16	772,050.16	319,410.54	1,390,203.86	30,517.497	83,091.354	390,429.28	2,011,429.29	19,751.748	2,408,709.85
本期 净 值 收 益 率	4.1995%	4.2499%	4.3178%	4.1363%	4.1363%	2.9094%	2.9623%	3.0280%	2.8471%	4.2087%	4.2630%	4.3346%	4.1476%
3. 1. 2 期 末 数 据 和 指 标	报告期(2017年12月31日)				报告期(2016年12月31日)				报告期(2015年12月31日)				
期 末 基 金 资 产 净 值	7,446,220.75	30,188,938.67	6,430,198.246	37,793,877.656	37,793,877.656	14,338,136.03	65,540,129.96	4,201,393.031	5,160,575.625	23,426,463.69	87,798,942.84	2,194,063.150	122,718,333.19
期 末 基 金	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

份 额 净 值												
------------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

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, 由于货币市场基金采用摊余成本法核算, 因此, 公允价值变动收益为零, 本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2. 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. 本基金收益分配为按日结转份额。

## 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

南方现金通货币 A

阶段	净值收益率 ①	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
过去三个月	1.0758%	0.0010%	0.3456%	0.0000%	0.7302%	0.0010%
过去六个月	2.1628%	0.0008%	0.6924%	0.0000%	1.4704%	0.0008%
过去一年	4.1995%	0.0011%	1.3781%	0.0000%	2.8214%	0.0011%
过去三年	11.7441%	0.0076%	4.1955%	0.0000%	7.5486%	0.0076%
自基金合同	16.7378%	0.0073%	5.5523%	0.0000%	11.1855%	0.0073%

南方现金通货币 B

阶段	净值收益率 ①	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
过去三个月	1.0887%	0.0010%	0.3456%	0.0000%	0.7431%	0.0010%
过去六个月	2.1884%	0.0007%	0.6924%	0.0000%	1.4960%	0.0007%
过去一年	4.2499%	0.0011%	1.3781%	0.0000%	2.8718%	0.0011%

过去三年	11.9138%	0.0076%	4.1955%	0.0000%	7.7183%	0.0076%
自基金合同	16.9778%	0.0072%	5.5523%	0.0000%	11.4255%	0.0072%

南方现金货币 C

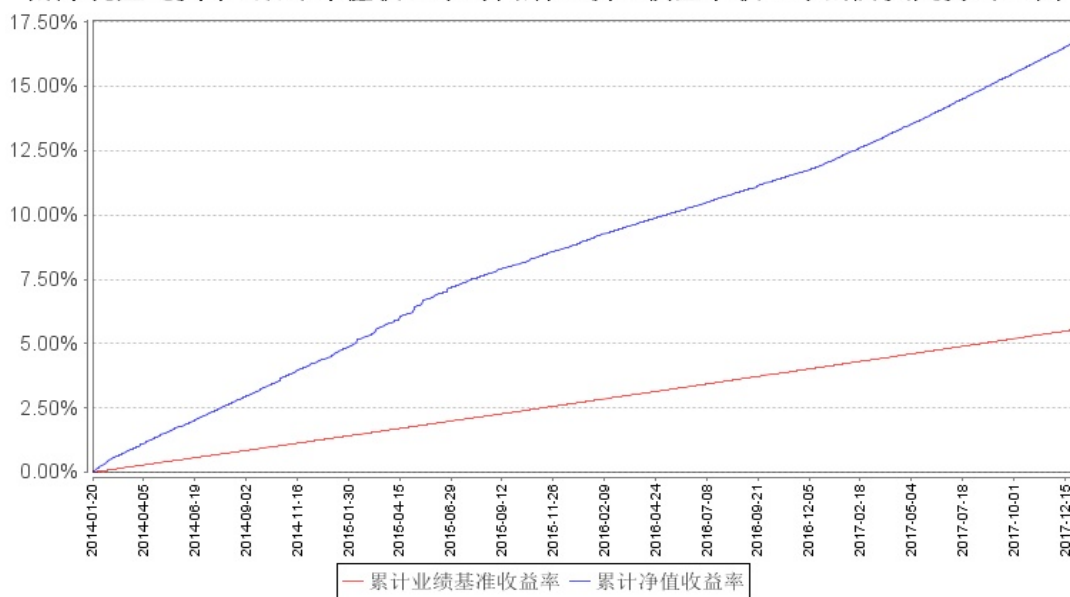
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.1057%	0.0010%	0.3456%	0.0000%	0.7601%	0.0010%
过去六个月	2.2228%	0.0007%	0.6924%	0.0000%	1.5304%	0.0007%
过去一年	4.3178%	0.0011%	1.3781%	0.0000%	2.9397%	0.0011%
过去三年	12.1353%	0.0076%	4.1955%	0.0000%	7.9398%	0.0076%
自基金合同	17.2838%	0.0072%	5.5523%	0.0000%	11.7315%	0.0072%

南方现金货币 E

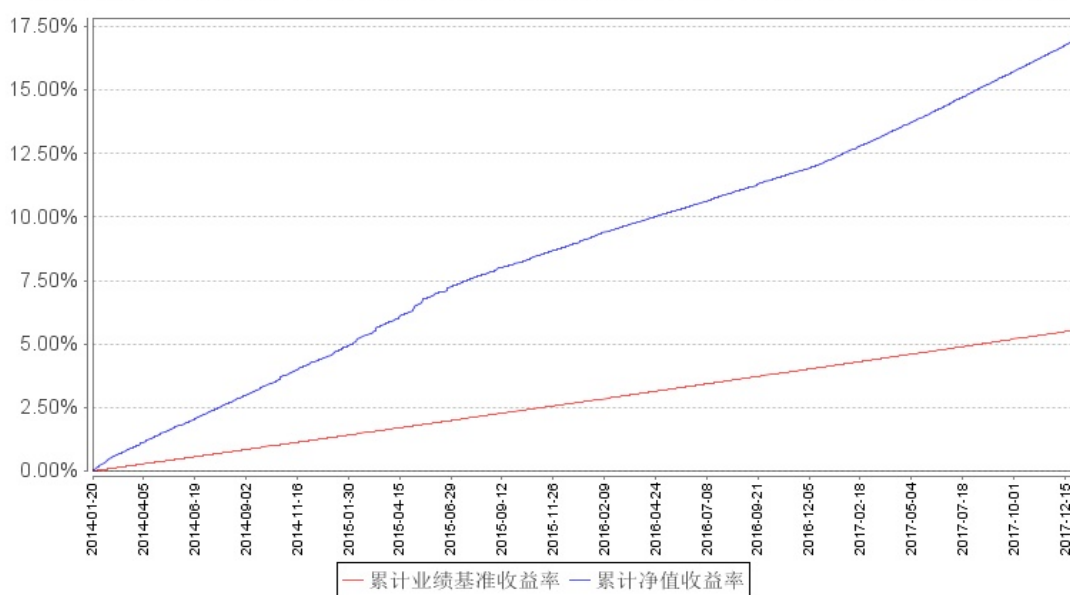
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.0639%	0.0010%	0.3456%	0.0000%	0.7183%	0.0010%
过去六个月	2.1346%	0.0007%	0.6924%	0.0000%	1.4422%	0.0007%
过去一年	4.1363%	0.0011%	1.3781%	0.0000%	2.7582%	0.0011%
过去三年	11.5434%	0.0076%	4.1955%	0.0000%	7.3479%	0.0076%
自基金合同	13.9539%	0.0075%	4.8894%	0.0000%	9.0645%	0.0075%

### 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

南方现金货币A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

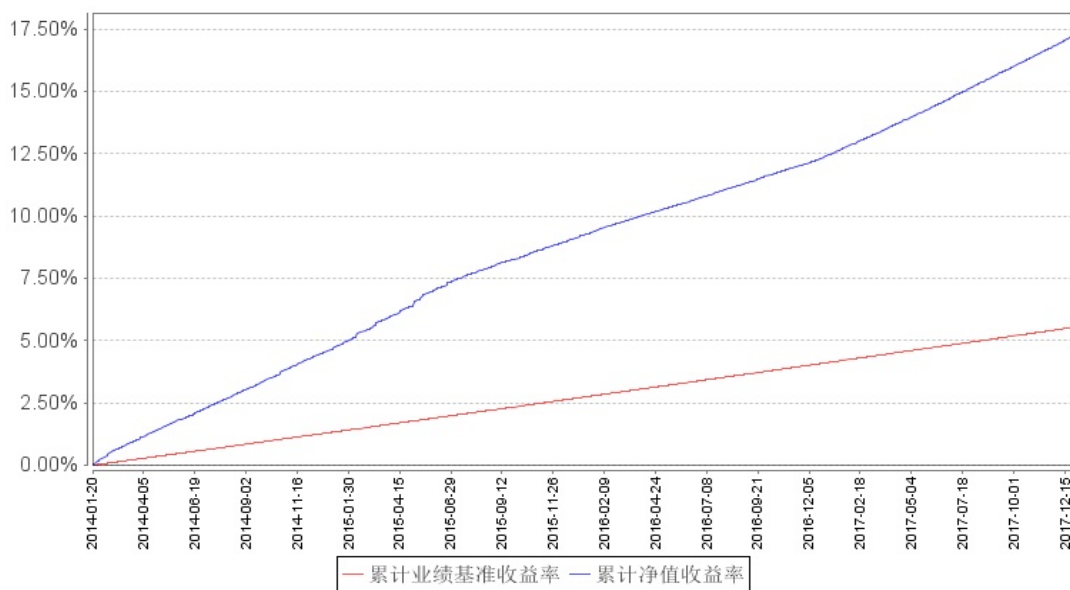


南方现金货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

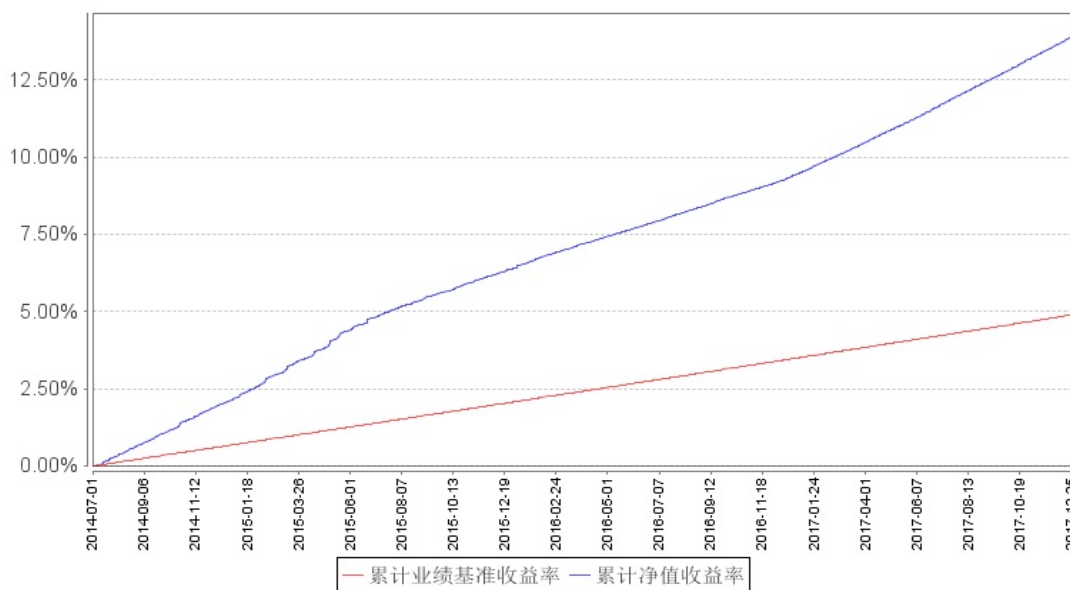




南方现金货币C累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

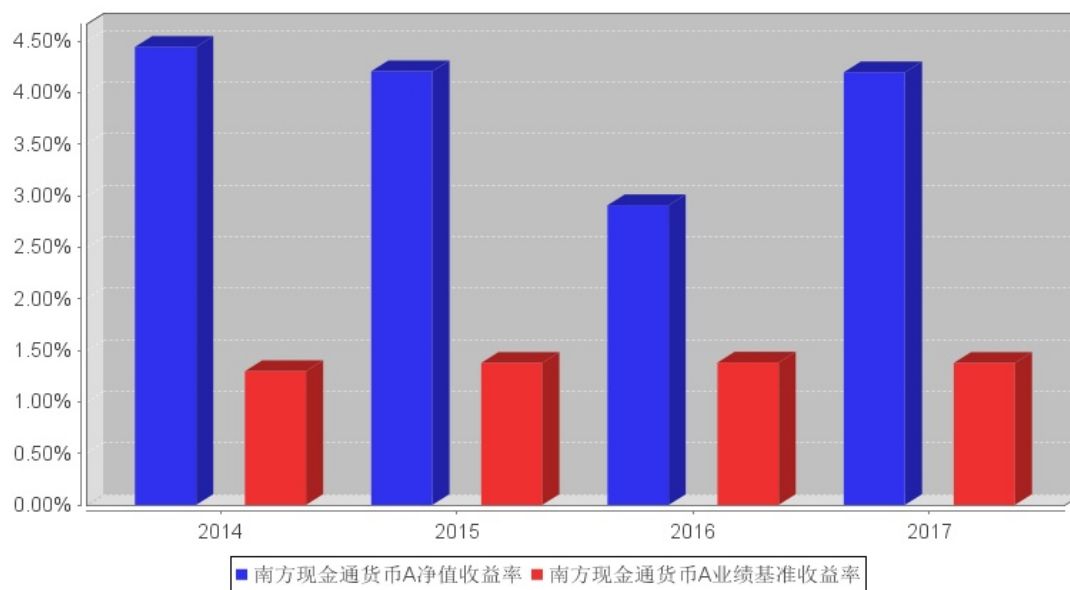


南方现金货币E累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

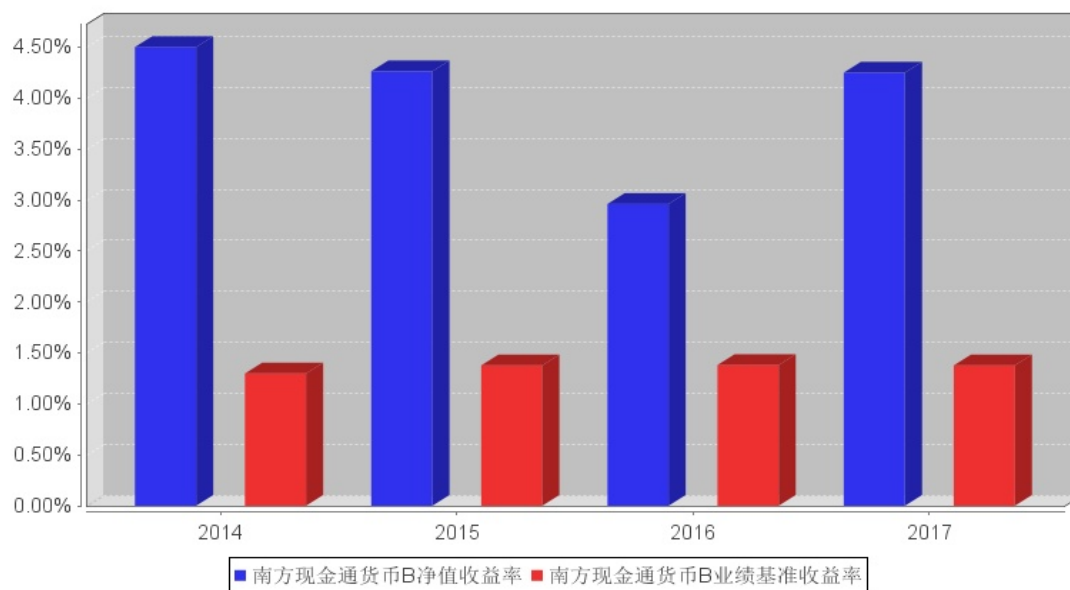


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

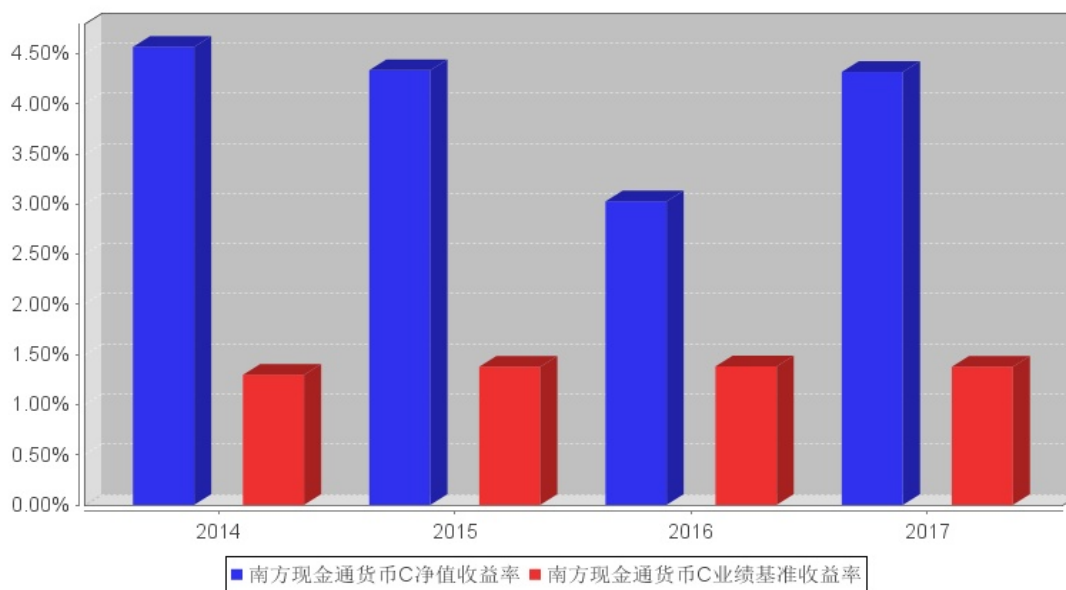
南方现金货币A基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



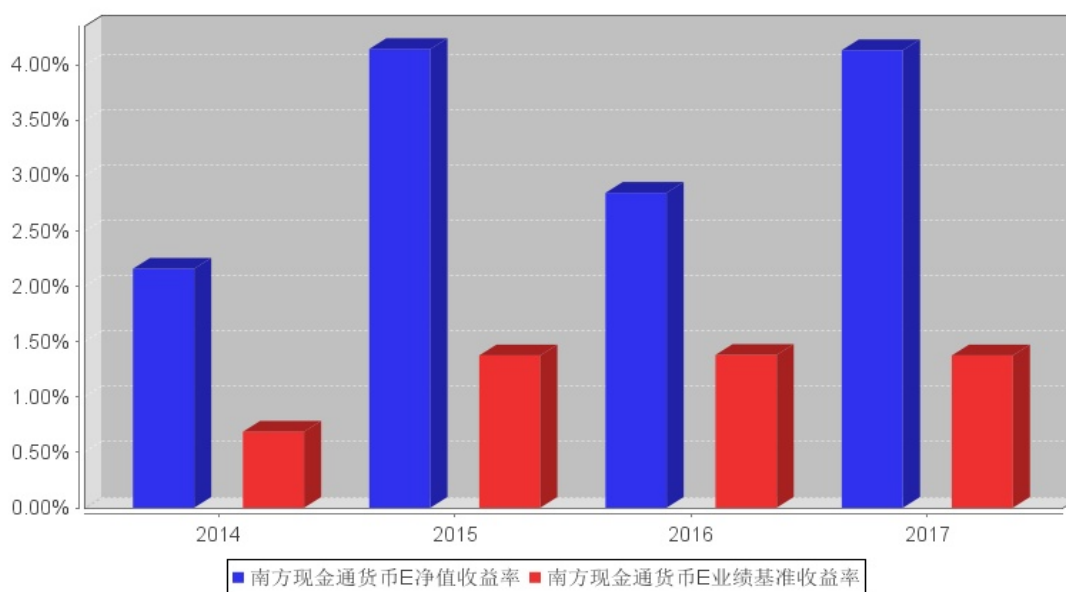
南方现金货币B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



南方现金货币C基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



南方现金货币E基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：元

南方现金货币 A

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2017 年	383,064.65			383,064.65	
2016 年	319,410.54	-	-	319,410.54	
2015 年	390,429.28	-	-	390,429.28	
合计	1,092,904.47	-	-	1,092,904.47	

## 南方现金货币 B

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2017 年	2,191,099.68			2,191,099.68	
2016 年	1,390,203.86	-	-	1,390,203.86	
2015 年	2,011,429.29	-	-	2,011,429.29	
合计	5,592,732.83	-	-	5,592,732.83	

## 南方现金货币 C

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2017 年	259,971,599.58			259,971,599.58	
2016 年	30,517,497.71	-	-	30,517,497.71	
2015 年	19,751,748.77	-	-	19,751,748.77	
合计	310,240,846.06			310,240,846.06	

## 南方现金货币 E

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2017 年	772,050,165.87			772,050,165.87	
2016 年	83,091,354.02	-	-	83,091,354.02	
2015 年	2,408,709.85	-	-	2,408,709.85	
合计	857,550,229.74			857,550,229.74	

## § 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。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金 3 亿元人民币。目前股权结构：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%及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，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超 7,200 亿元，旗下管理 153 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、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7月25日	-	12	<p>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，现任现金投资部总经理、固定收益投资决策委员会副主席。</p> <p>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；2013年1月至2014年12月，任南方理财30天基金经理；2012年7月至2015年1月，任南方润元基金经理；2014年7月至2016年11月，任南方薪金宝基金经理；2014年12月至2016年11月，任南方理财金基金经理；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；2014年7月至今，任南方现金增利、南方现金通基金经理；2014年12月至今，任南方收益宝基金经理；2016年2月</p>

					至今，任南方日添益货币基金经理；2016 年 10 月至今，任南方天天利基金经理；2017 年 8 月至今，任南方天天宝基金经理。
董浩	本基金基金经理	2015 年 9 月 11 日	-	7	南开大学金融学硕士，具有基金从业资格。2010 年 7 月加入南方基金，历任交易管理部债券交易员、固定收益部货币理财类研究员；2014 年 3 月至 2015 年 9 月，任南方现金通基金经理助理；2015 年 9 月至 2016 年 8 月，任南方 50 债基金经理；2015 年 9 月至今，任南方现金通、南方中票基金经理；2016 年 2 月至今，任南方日添益货币基金经理；2016 年 8 月至今，任南方 10 年国债基金经理；2016 年 11 月至今，任南方理财 60 天基金经理；2017 年 8 月至今，任南方天天宝基金经理。

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，“离职日期”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《南方现金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。

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为5次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数型基金成份股调整所致，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，美国经济温和扩张，全年共加息 3 次，符合市场预期，美联储今年 10 月开始缩表，初始规模为 100 亿/月，每 3 个月提高 100 亿，并最终达到 500 亿/月的水平。此外，特朗普税改法案成功落地。欧洲经济表现较好，多项指标创金融危机后的新高，欧央行对经济和通胀预期乐观，将从 2018 年 1 月份开始缩减月度 QE 规模至 300 亿，并持续到 9 月份，但目前通胀依然较低，对是否会退出 QE 欧央行持保留态度。日本央行仍维持 10 年期利率 0% 的目标，将继续实施超宽松货币政策。全球经济今年以来共振复苏，尤其是制造业改善明显，货币政策进入边际收紧的通道，全球主要经济体债市收益率整体保持震荡走势。

国内方面，全年经济展现了较强的韧性，GDP 增速较去年小幅回升，前三季度累计同比增长 6.9%，工业增加值年内波动较大，全年增速预计稳定在 6.5 左右。通胀方面，CPI 保持温和走势，全年均值为 1.6%，PPI 全年高位运行。

政策方面，货币政策中性偏紧，全年 3 次上调公开市场利率。央行 9 月底宣布定向降准，但要到 2018 年开始执行，央行主要采用公开市场操作、MLF 等提供流动性，10 月底央行创设 63 天逆回购，12 月底建立“临时准备金动用安排”，全年资金面呈现紧平衡的态势。受益于美元指数下跌，全年人民币兑美元录得较大升值。在央行中性偏紧的政策态度下，资管新规、流动性新规相继出台，金融监管进一步加强。

市场方面，全年债市处于熊市之中。前 5 月，经济基本面底部回升，同时在央行连续加息和监管加强的影响下，债市收益率大幅上行，信用利差大幅走扩，期限利差进一步压缩。进入 6 月后，央行出面加强监管协调，同时资金面未如预期的紧张，市场情绪逐渐平稳，收益率出现回落，随后三季度维持了震荡的格局。但进入四季度后，经济基本面依旧维持较强的韧性，同时监管文件逐步出台，债市再次出现较大下跌。目前收益率较去年末大幅上行，信用利差走扩，期限利差压缩，全年债市走出震荡上行的熊市。货币市场利率呈现高位震荡行情，四季度收益率再创新高，表明金融市场整体流动性紧张程度仍未有效缓解。在基金运作上，我们整体保持了适中久期，在流动性和收益性之间保持平衡，为客户提供了稳健收益。

#### 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 4.1995%，同期业绩比较基准收益率为 1.3781%。B 级基金净值收益率为 4.2499%，同期业绩比较基准收益率为 1.3781%。C 级基金净值收益率为 4.3178%，同期业绩比较基准收益率为 1.3781%。E 级基金净值收益率为 4.1363%，同期业绩比较基准收益率为 1.3781%。



## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济层面，12月中采制造业PMI有所回落，但回落幅度较小。生产和新订单指数均有所回落，但新出口订单指数大幅上升，创下年内次高值，反映外需情况依然较好。综合来看，经济依然保持着较强的韧性。通胀方面，明年CPI中枢上升至2.5%左右，但难以达到3.0%的高度；明年PPI中枢回落至3.0%左右，较今年显著下降。

政策层面，美联储加息靴子落地，欧央行明年开始削减月度购债规模。海外央行依然处于货币政策边际收紧的通道中，但人民币汇率表现较好，央行货币政策受到的压力较小。四季度央行跟随美联储上调了公开市场利率，同时建立了“临时准备金动用安排”，维护春节期间的流动性稳定，继续维持不松不紧的政策态度。但监管政策依然严格，四季度相继发布了资管新规和流动性新规的征求意见稿，监管对市场依然存在较大影响。

债市策略方面，预计2018年消费平稳、投资继续下滑，出口边际拉动有所减弱。结合通胀整体平稳的判断，预计2018年名义增速大概率稳中有落，经济基本面情况或支持利率水平有所下降。但加强金融监管仍是明年主题，或导致市场利率较长期偏离与经济增速相适宜的水平。目前扰动债券市场的，无论是明年的通胀预期，货币政策，还是金融监管，都是偏中长期的因素，债市的磨顶时期或较长，仍需要耐心等待基本面和政策面更加明确的信号。在当前紧信用的背景下，企业融资环境恶化，需要严防信用风险，加强对于持仓债券的跟踪和梳理。我们将继续保持组合的良好流动性，为广大客户提供稳健优秀的投资收益。

## 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。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。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，本基金采用“每日分配、按日支付”，即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。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对南方现金货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关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，南方现金货币市场基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方现金货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

#### 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股份有限公司编制和披露的南方现金货币市场基金 2017 年年度报告中财务指标、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

本基金本报告期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(2018)第 22794 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通

过年度报告正文察看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：南方现金通货币市场基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产		本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		26,971,396,084.56	3,222,714,939.06
结算备付金		30,186,730.72	3,530,006.38
存出保证金		4,218.80	23,293.52
交易性金融资产		21,471,317,376.70	3,105,797,604.64
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		21,359,317,376.70	3,105,797,604.64
资产支持证券投资		112,000,000.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	3,126,718,414.50
应收证券清算款		-	-
应收利息		159,167,844.77	35,918,509.80
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		7,500.00	7,500.00
资产总计		48,632,079,755.55	9,494,710,267.90
<b>负债和所有者权益</b>		<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2017 年 12 月 31 日</b>	<b>2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		4,346,962,519.54	50,000,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,504,383.66	1,140,765.46
应付托管费		1,774,870.47	248,429.64
应付销售服务费		7,221,167.91	1,115,073.26

应付交易费用		162,745.69	54,688.10
应交税费		-	-
应付利息		5,261,005.98	6,388.88
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		482,000.00	298,000.00
负债合计		4,370,368,693.25	52,863,345.34
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		44,261,711,062.30	9,441,846,922.56
未分配利润		-	-
所有者权益合计		44,261,711,062.30	9,441,846,922.56
负债和所有者权益总计		48,632,079,755.55	9,494,710,267.90

注:1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.0000 元, 基金份额总额

44,261,711,062.3 份, 其中 A 级基金份额总额 7,446,220.75 份, B 级基金份额总额

30,188,938.67 份, C 级基金份额总额 6,430,198,246.24 份, E 级基金份额总额

37,793,877,656.64 份。

## 7.2 利润表

会计主体: 南方现金货币市场基金

本报告期: 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	1,205,810,405.06	143,564,482.47
1. 利息收入	1,197,712,833.02	133,601,345.20
其中: 存款利息收入	599,461,245.98	54,250,548.48
债券利息收入	516,849,824.35	61,426,266.98
资产支持证券利息 收入	2,008,263.70	-
买入返售金融资产 收入	79,393,498.99	17,924,529.74
其他利息收入	-	-
2. 投资收益(损失以“- ”填列)	8,097,572.04	9,963,137.27
其中: 股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	8,039,139.17	9,963,137.27
资产支持证券投资 收益	58,432.87	-
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)		-	-
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)		-	-
减：二、费用		171,214,475.28	28,246,016.34
1. 管理人报酬		57,325,859.65	9,340,982.47
2. 托管费		12,456,111.90	2,035,542.26
3. 销售服务费		54,892,226.47	9,127,285.12
4. 交易费用		1,500.00	-
5. 利息支出		45,922,518.33	7,244,941.25
其中：卖出回购金融资产支出		45,922,518.33	7,244,941.25
6. 其他费用		616,258.93	497,265.24
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,034,595,929.78	115,318,466.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,034,595,929.78	115,318,466.13

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方现金通货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	9,441,846,922.56	-	9,441,846,922.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1,034,595,929.78	1,034,595,929.78
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）	34,819,864,139.74	-	34,819,864,139.74
其中：1. 基金申购	218,067,239,349.96	-	218,067,239,349.96

款			
2. 基金赎回款	-183,247,375,210.22	-	-183,247,375,210.22
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）	-	-1,034,595,929.78	-1,034,595,929.78
五、期末所有者权益（基金净值）	44,261,711,062.30	-	44,261,711,062.30
项目	上年度可比期间 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）	2,428,006,889.80	-	2,428,006,889.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	115,318,466.10	115,318,466.13
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）	7,013,840,032.76	-	7,013,840,032.76
其中：1. 基金申购款	48,126,863,282.45	-	48,126,863,282.45
2. 基金赎回款	-41,113,023,249.69	-	-41,113,023,249.69
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）	-	-115,318,466.13	-115,318,466.13
五、期末所有者权益（基金净值）	9,441,846,922.56	-	9,441,846,922.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松

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

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。

### 7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.2.1 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。

#### 7.4.2.2 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。

#### 7.4.2.3 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。

### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、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	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(“南方资本”)	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
深圳南方股权投资基金管理有限公司(“南方股权”)	基金管理人的孙公司

注:1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于2018年1月4日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

#### 7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.5.2 关联方报酬

###### 7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	57,325,859.65	9,340,982.47



其中：支付销售机构的客户维护费	755,331.53	-
-----------------	------------	---

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日该类份额(扣除当日该类份额升级的部分)的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。A类基金份额、B类基金份额、C类基金份额和E类基金份额约定的年管理费率为0.27%、0.22%、0.17%和0.25%。其计算公式为： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日该类份额(扣除当日该类份额升级的部分)的基金资产净值} \times \text{该类基金份额年管理费率} / \text{当年天数}$ 。

#### 7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	12,456,111.90	2,035,542.26

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}$ 。

#### 7.4.5.2.3 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 2017年1月1日至2017年12月31日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	南方现金货币 A	南方现金货币 B	南方现金货币 C	南方现金货币 E	合计
南方基金	20,061.27	97,593.93	9,226,801.69	43,128,506.41	52,472,963.30
华泰证券	-	-	-	51,434.18	51,434.18
合计	20,061.27	97,593.93	9,226,801.69	43,179,940.59	52,524,397.48
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间 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				
	南方现金货币 A	南方现金货币 B	南方现金货币 C	南方现金货币 E	合计

名称					
南方基金	24,422.33	87,440.64	1,495,846.55	7,356,587.56	8,964,297.08
华泰证券	-	-	-	0.01	0.01
合计	24,422.33	87,440.64	1,495,846.55	7,356,587.57	8,964,297.09

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日该类份额(扣除当日该类份额升级的部分)的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，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、B类基金份额、C类基金份额和E类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%、0.20%、0.15%和0.25%。根据《南方基金关于旗下南方现金通货币市场基金E类销售服务费优惠的公告》及《南方基金关于停止旗下南方现金通货币市场基金E类销售服务费优惠的公告》，E类基金份额自2017年12月4日起至12月10日止期间及2017年12月15日起至12月17日止期间销售服务费年费率为0.125%。销售服务费的计算公式为： $\text{日销售服务费} = \text{前一日该类份额(扣除当日该类份额升级的部分)的基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}$ 。

### 7.4.5.3 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 2017年1月1日至2017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
中国工商银行	120,303,269.07	499,578,652.17	-	-	-	-
上年度可比期间 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
中国工商银行	161,581,402.62	172,047,086.26	-	-	-	-

### 7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.5.4.1 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 2017年01月 01日至2017年 12月31日	本期 2017年01月 01日至2017年 12月31日	本期 2017年01月 01日至2017年 12月31日	本期 2017年01月 01日至2017年 12月31日
	南方现金通货 A	南方现金通货 B	南方现金通货 C	南方现金通货 E
基金合同生效 日（2014年 01月21日）持 有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基 金份额	56,018.84	112,213.72	3,377,082.91	
期间申购/买入 总份额	2,352.14	4,768.35	145,800.44	
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	58,370.98	116,982.07	3,522,883.35	
期末持有的基 金份额 占基金总份 额比例	0.78%	0.39%	0.05%	
项目	上年度可比期间 2016年01月 01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2016年01月 01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2016年01月 01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2016年01月 01日至2016年 12月31日
	南方现金通货 A	南方现金通货 B	南方现金通货 C	南方现金通货 E
基金合同生效 日（2014年 01月21日）持 有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基 金份额	54,437.76	108,990.76	202,746,983.07	-
期间申购/买入 总份额	1,587.54	3,236.16	630,506.72	-
期间因拆分变 动份额	-	-	-	-
减：期间赎回	-	-	200,000,000.00	-

/卖出总份额				
期末持有的基金份额	56,025.30	112,226.92	3,377,489.79	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.39%	0.17%	0.08%	-

注:期间申购/买入总份额含红利再投、级别调整入份额,期间赎回/卖出总份额含级别调整出份额。

#### 7.4.5.4.2 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

南方现金货币 C

关联方名称	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016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(%)
南方资本	244,732,303.40	3.81%	-	-
南方股权	11,284,469.05	0.18%		

注:南方资本投资本基金相关的费用按本基金招募说明书的有关规定执行。

#### 7.4.5.5 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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中国工商银行股份有限公司	1,396,084.56	4,003,180.48	20,714,939.06	55,008.05

注:本基金的活期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。

#### 7.4.5.6 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。

### 7.4.5.7 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。

### 7.4.6 期末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

注:本基金本期末未持有的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 2017 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 4,346,962,519.54 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
111708376	17 中信银行 CD376	2018-01-02	99.55	7,000,000	696,835,872.17
111709484	17 浦发银行 CD484	2018-01-02	98.00	10,870,000	1,065,265,960.19
111711451	17 平安银行 CD451	2018-01-02	99.69	10,000,000	996,912,794.20
111711492	17 平安银行 CD492	2018-01-02	98.16	761,000	74,699,890.08
111715421	17 民生银行 CD421	2018-01-02	98.15	9,835,000	965,333,433.17
111715458	17 民生银行 CD458	2018-01-02	99.13	4,777,000	473,556,672.71
111717300	17 光大银行 CD300	2018-01-04	97.83	412,000	40,306,737.63
111717300	17 光大银行 CD300	2018-01-05	97.83	3,337,000	326,465,008.41
合计				46,992,000	4,639,376,368.56

### 7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 21,471,317,376.70 元，无属于第一或第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第二层次 3,105,797,604.64 元，无第一或第三层次)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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

#### (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融

房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益权益投资	21,471,317,376.70	44.15
	其中：债券	21,359,317,376.70	43.92
	资产支持证券	112,000,000.00	0.23
2	买入返售金融资产	-	-
	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	27,001,582,815.28	55.52
4	其他各项资产	159,179,563.57	0.33
5	合计	48,632,079,755.55	100.00

### 8.2 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	5.53	
	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	4,346,962,519.54	9.82
	其中：买断式回购融资	-	-

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。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：本基金合同约定：“本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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	104
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

### 8.3.2 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，本基金未发生超标情况。

### 8.3.3 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	21.92	9.82
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	7.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	30.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	1.15	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	48.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	109.51	9.82



## 8.4 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,本基金未发生平均剩余存续期超过 240 天的情况。

## 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	647,516,277.44	1.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,597,495,633.72	3.61
	其中:政策性金融债	1,597,495,633.72	3.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	561,315,864.61	1.27
6	中期票据	-	-
7	同业存单	18,552,989,600.93	41.92
8	其他	-	-
9	合计	21,359,317,376.70	48.26
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

## 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位: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	111717300	17 光大银行 CD300	20,000,000	1,956,637,748.93	4.42
2	111715421	17 民生银行 CD421	15,000,000	1,472,292,983.99	3.33
3	111710633	17 兴业银行 CD633	12,000,000	1,174,943,059.29	2.65
4	111709484	17 浦发银行 CD484	11,000,000	1,078,006,031.47	2.44
5	111711451	17 平安银行 CD451	10,000,000	996,912,794.20	2.25

6	111719218	17 恒丰银行 CD218	7,300,000	728,529,882.54	1.65
7	111708376	17 中信银行 CD376	7,000,000	696,835,872.17	1.57
8	111720257	17 广发银行 CD257	7,000,000	696,026,888.59	1.57
9	111715458	17 民生银行 CD458	7,000,000	693,928,555.37	1.57
10	111710635	17 兴业银行 CD635	6,000,000	594,795,909.74	1.34

## 8.7 “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	0.1174%
报告期内偏离度的最低值	-0.0685%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0375%

## 8.8 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%情况。

### 8.8.1 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%情况。

## 8.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	116638	万科 10A1	900,000	90,000,000.00	0.20
2	116614	万科 8A1	220,000	22,000,000.00	0.05

## 8.10 投资组合报告附注

### 8.10.1

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。

## 8.10.2

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。

## 8.10.3 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	4,218.80
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	159,167,844.77
4	应收申购款	-
5	其他应收款	7,500.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	159,179,563.57

## § 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(%)
南方现金通A	796	9,354.55	208,930.71	2.81	7,237,290.04	97.19
南方现金通B	1,073	28,135.08	714,924.62	2.37	29,474,014.05	97.63
南方现金通C	100,587	63,926.73	4,991,016,895.29	77.62	1,439,181,350.95	22.38
南方现金通E	13,795,413	2,739.60	1,670,489,392.42	4.42	36,123,388,264.22	95.58

合计	13,897,869	3,184.78	6,662,430,143.04	15.05	37,599,280,919.26	84.95
----	------------	----------	------------------	-------	-------------------	-------

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 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例(%)
1	银行	1,501,090,931.46	3.39%
2	基金	816,201,246.54	1.84%
3	银行	503,898,133.13	1.14%
4	其他机构	502,450,581.19	1.14%
5	银行	377,434,882.14	0.85%
6	银行	301,198,250.93	0.68%
7	基金	244,732,303.40	0.55%
8	基金	209,399,453.12	0.47%
9	证券	204,609,926.88	0.46%
10	银行	204,318,138.66	0.46%

## 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	南方现金货币 A	7,853.49	0.1055
	南方现金货币 B	310,068.58	1.0272
	南方现金货币 C	8,836,716.38	0.1374
	南方现金货币 E	49,431,284.76	0.1308
	合计	58,585,923.21	0.1324

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

## 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式	南方现金货币 A	-
	南方现金货币 B	-

基金	南方现金货币 C	>100
	南方现金货币 E	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有 本开放式基金	南方现金货币 A	-
	南方现金货币 B	-
	南方现金货币 C	10~50
	南方现金货币 E	0~10
	合计	10~50

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方现金货币 A	南方现金货币 B	南方现金货币 C	南方现金货币 E
基金合同生效日 (2014 年 1 月 21 日) 基金份额总额	212,363,225.89	12,083,651.25	190,758,832.36	-
本报告期初 基金份额总额	14,338,136.03	65,540,129.96	4,201,393,031.28	5,160,575,625.29
本报告期基 金总申购份 额	21,697,987,682.02	1,943,491,778.09	21,381,498,734.71	173,044,261,155.14
减：本报告 期基金总赎 回份额	21,704,879,597.30	1,978,842,969.38	19,152,693,519.75	140,410,959,123.79
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	7,446,220.75	30,188,938.67	6,430,198,246.24	37,793,877,656.64

注：1. 本基金 A 类基金份额开放认购、申购和赎回业务，B 类和 C 类基金份额不开放申购业务，只开放赎回业务。B 类和 C 类基金份额是根据持有时间或持有数量在满足一定条件后由系统自动升级生成。上表中申购、赎回份额均包含份额升级部分。2. 根据 2014 年 7 月 2 日刊登《关于南方现金货币市场基金增加基金份额类别、开放申购赎回业务并修改基金合同的公告》，决定增

加南方现金货币市场基金的 E 类份额类别、开放申购赎回业务，E 类份额自 2014 年 7 月 4 日起开放申购和赎回业务，不随持有时间或持有数量升级或降级为其他基金份额类别。

## § 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

2017 年 1 月 23 日南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议，审议通过秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

2017 年 12 月 8 日南方基金管理股份有限公司（筹）第一届董事会第一次会议，审议通过聘任史博担任公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内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 173,000.00 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、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	-	-	-	-	
华泰证券	1	-	-	-	-	

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
华泰证券	-	-	1,283,187,000.00	2.43%	-	-
银河证券	157,649,418.90	100.00%	51,518,100,000.00	97.57%	-	-

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。

## 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：无。