

南方丰元信用增强债券型证券投资基金

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08月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金管理人和基金托管人根据本基金合同规定，于2018年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等，确保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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告书内容未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方丰元信用增强债券型证券投资基金
基金名称	南方丰元信用增强债券型证券投资基金
基金代码	000366
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月12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
报告期末基金资产总额	96,382,670,020份
基金合同的存续期	不长期
下属分级基金的基金简	
南方丰元信用增强债券A	南方丰元信用增强债券C
下属分级基金的交易代	000366
000366	
报告期末下属分级基	72,583,198,09份
金的份额总额	24,360,492,913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,简称为“南方丰元”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在综合分析宏观经济环境、货币政策、宏观经济指标以及资金面分 析的基础上,进行债券投资的择时和久期、类属配置、套利操作的债券投资 策略,以获取较佳的债券投资收益。
业绩比较基准	中债国债到期收益率
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	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	周克军	郭明
联系电话	0755-82763888	010-66106798
电子邮箱	manager@nffund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-889-8999	96688
传真	0755-82763889	010-66106799

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址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

	金额单位:人民币元
3.1.1 期间数据和指标	报告期2018年01月01日至-2018年06月30日(303日)
南方丰元信用增强债券A	南方丰元信用增强债券C
本期已实现收益	2,419,101.07
3,394,070.06	3,061,536.07
加权平均基金份额本期利润	0.0429
本期利润	0.038%
加权平均基金份额净值	1.00%
风险收益特征	4.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期2018年06月30日(303日)
期末可供分配利润	4,209,442.65
期末可供分配基金份额利润	1,010,071.76
期末基金资产净值	0.09890
期末基金份额净值	81,046,187.03
期末基金资产总额	81,046,187.03
期末基金负债总额	1,120
注:注:本期已实现收益指本基金本期利息收入、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扣除相关费用后的余额,本期利润率为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。	1,113

注:本期可供分配利润,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率将低于所列数字。

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

阶段	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
过去一个月	0.98%	0.00%	0.00%	0.00%	0.98%	0.00%
过去二个月	1.53%	0.11%	0.27%	0.06%	1.16%	0.06%
过去三个月	3.82%	0.09%	1.49%	0.06%	2.34%	0.04%
过去一年	2.77%	0.09%	0.16%	0.04%	2.61%	0.06%
过去三年	9.20%	0.13%	-15.6%	0.07%	10.76%	0.06%
自基金合同生效至今	27.94%	0.14%	4.6%	0.07%	23.28%	0.07%

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

注:1.本基金在2012年11月12日成立,2013年7月10日开始办理日常申购赎回业务,2013年7月10日至2014年1月12日期间为基金的封闭期,2014年1月12日起至2014年6月30日为本基金的开放期,2014年7月1日起进入下一个封闭期,以此类推。

2.截至报告期末,南方基金管理有限公司15%及以上的股东为公司100%。

3.所述基金业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率将低于所列数字。

3.2.3 基金管理费

3.2.3.1 基金管理费的计提方法、计提标准、扣除方式和计算方法

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.35%逐日计提,并按月支付。

3.2.3.2 基金管理费的费率

本基金的管理费率为0.35%。

3.2.3.3 基金管理费的计算方法

本基金的管理费每日按基金资产净值乘以管理费率计算,并按月支付。

3.2.3.4 基金管理费的计提和支付

本基金的管理费由基金管理人按月计提,并按月支付给基金管理人。

3.2.3.5 基金管理费的调整

本基金的管理费率不变。

3.2.3.6 基金管理费的用途

本基金的管理费主要用于本基金的日常管理,包括基金管理人对基金的日常管理、基金的宣传、基金的销售、基金的客户关系维护、基金的会计核算、基金的估值和信息披露、基金的绩效评估等。

3.2.3.7 基金管理费的纳税

本基金的管理费在缴纳增值税时,按国家税法规定比例由基金管理人承担。

3.2.3.8 基金管理费的复核

基金管理人每年聘请会计师事务所对基金管理费的计提情况进行复核。

3.2.3.9 基金管理费的审计

基金管理人每年聘请会计师事务所对基金管理费的计提情况进行审计。

3.2.3.10 基金管理费的披露

基金管理人将在定期报告中披露基金管理费的计提、使用、复核及审计情况。

3.2.3.11 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.12 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.13 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.14 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.15 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.16 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.17 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.18 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.19 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.20 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.21 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.22 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.23 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.24 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.25 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.26 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.27 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2.3.28 基金管理费的变更

本基金的管理费率不变。

3.2