

南方多元债券型发起式证券投资基金

2018年半年度报告摘要

基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
送出日期:2018年08月27日

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
李璇	本基金基金经理	2016年9月26日 - 至今	10	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,历任固定收益投资部总经理,固定收益投融资决策委员会委员,2010年月至2012年6月,任南方多元债券基金经理,2012年12月至2014年9月,任南方安心基金经理,2015年12月至2017年2月,任南方多元债券基金经理,2017年7月至2017年9月,任南方稳利基金经理,2018年8月27日至2017年12月,任南方稳利、南方荣冠基金经理,2016年11月至2018年2月,任南方多元债券基金经理,2018年11月至2018年2月,任南方多元债券基金经理,2018年10月至今,任南方多元债券基金经理,2012年6月至今,任南方多元债券基金经理,2016年12月至今,任南方多元债券基金经理,2017年1月至今,任南方安心、南方利和基金经理,2017年3月至今,任南方荣冠基金经理,2017年7月至今,任南方荣冠基金经理,2017年9月至今,任南方利和基金经理。

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本报告期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
银行存款	123,879.76	658,869.41
结算备付金	1,963,989.09	30,529,126.21
存出保证金	167,019.97	60,184.03
交易性金融资产	10,482,382.60	2,879,187,883.30
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	10,482,382.60	2,879,187,883.30
资产支持证券投资	-	6,983,900.00
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收利息	1,401,944.76	5,292,481.27
应收申购款	396,500.00	58,596,319.98
其他资产	-	-
资产总计	14,524,817.07	2,973,624,844.20
负债和所有者权益	2018年6月30日	2017年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
应付短期融资券	-	-
应付债券	1,280,000.00	1,284,982,756.37
其中:应付短期融资券	1,280,000.00	1,284,982,756.37
应付利息	1,121,183.63	5,150,193.61
应付管理人报酬	289,689.96	741,064.24
应付托管费	96,383.33	247,021.42
应付销售服务费	-	-
应交税费	21,889.32	35,546.59
其他应付款	186,676.78	-
预收账款	-622.89	1,026,487.14
其他负债	-	-
负债合计	3,119,122.73	440,000.00
所有者权益:		
实收基金	10,000,000.00	1,680,020,946.10
未分配利润	1,411,118.31	21,000,460.63
所有者权益合计	11,411,118.31	1,701,021,406.73
负债所有者权益总计	14,524,817.07	2,973,624,844.20

注:报告截止日2018年06月30日,基金份额净值1.1411元,基金份额总额为10,000,000.00份。

6.2 利润表

会计主体:南方多元债券型发起式证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	41,818,178.28	163,585,508.61
利息收入	39,795,050.20	207,003,262.52
其中:存款利息收入	1,127,526.60	24,132,687.20
债券利息收入	38,170,114.77	176,484,418.52
资产支持证券利息收入	104,526.79	-
买入返售金融资产收入	2,136,902.36	6,385,174.89
其他利息收入	-	-
投资收益(损失以“-”号填列)	-86,846,850.75	-63,993,815.70
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-86,811,412.76	-63,982,875.70
资产支持证券投资收益	64,540.01	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	89,694,342.98	39,149,616.02
汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
其他综合收益	215,629.05	1,436,464.79
二、费用	6,413,709.89	27,530,324.17
其中:管理人报酬	2,432,091.74	15,528,882.21
2.1 托管费	810,627.27	5,312,861.22
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	26,964.11	83,897.63
5. 利息支出	2,795,091.38	16,001,643.46
其中:卖出回购金融资产支出	2,795,091.38	16,001,643.46
6. 税金及附加	121,321.32	-
7. 其他费用	228,542.27	263,982.06
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	36,404,470.19	126,014,674.36
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	36,404,470.19	126,014,674.36

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:南方多元债券型发起式证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

项目	2018年1月1日至2018年6月30日		所有者权益合计
	实收基金	未分配利润	
一、期初所有者权益(基金净值)	1,680,020,946.10	21,000,460.63	1,701,021,406.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	36,404,470.19	36,404,470.19
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)	-1,670,020,946.10	-64,993,812.71	-1,735,014,758.81
其中:基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,670,020,946.10	-64,993,812.71	-1,735,014,758.81
四、本期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)	10,000,000.00	1,411,118.31	11,411,118.31
六、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)	-6,720,630,940.36	19,782,768.72	-6,700,827,152.64
其中:基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-6,720,630,940.36	19,782,768.72	-6,700,827,152.64
七、期末所有者权益(基金净值)	6,279,420,946.10	16,582,159.07	6,326,978,190.67

报告附注为财务报表的组成部分。
本报告6.1至6.6财务报表由下列负责人签署:

杨小松 徐刚
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 差错更正的说明
本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 税项
根据财政部、国家税务总局财税[2009]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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]16号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]190号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(a) 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。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日前发行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。
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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。
(b) 对基金从事证券市场中取得收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,都不征收企业所得税。
(c) 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的个人所得税。
(d) 本基金的国债利息收入、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。
6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方

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,注册地四川,基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人,基金销售机构

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《南方基金管理股份有限公司名称变更的公告》,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。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
本基金报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 股票交易
注:无。

6.4.5.1.2 权证交易
注:无。

6.4.5.1.3 应支付关联方的佣金
注:无。

6.4.5.2 关联方报酬
6.4.5.2.1 基金管理费

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的基金管理费	2,432,091.74	15,528,882.21
其中:支付销售机构的客户维护费	804,738.16	-

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0.30%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×0.30%/当年天数。

6.4.5.2.2 基金托管费

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	810,627.27	5,312,861.22

注:支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.5.2.3 销售服务费
注:无。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
注:无。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.5.4.1 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
基金合同生效日(2016年9月26日)持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	100.0000%	0.1595%

6.4.5.4.2 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
注:无。

6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	期末余额	当期利息收入
交通银行	123,879.76	138,123.97
交通银行股份有限公司	123,879.76	1,399,176.79
合计	123,879.76	402,230.23

注:本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.5.6 本基金在报告期内参与关联方承销证券的情况
注:本基金在报告期内未参与关联方承销的证券。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明
本基金报告期内无其他关联交易事项。

6.4.6 期末未兑付的流通受限证券
6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
注:无。

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
注:无。

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购
注:无。

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2018年06月30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1,200,000.00元,于2018年7月2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。

6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
注:无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	-	-
其中:股票	-	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,482,382.60	72.17
其中:债券	10,482,382.60	72.17	
资产支持证券	-	-	
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	2,087,879.84	14.37
8	其他各项资产	1,064,566.63	7.36
9	合计	14,524,817.07	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
7.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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
注:无。

7.4 本报告期末股票投资重大变动
7.4.1 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:无。

7.4.2 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:无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
注:无。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,063,139.40	14.48
其中:政策性金融债	602,200.000	6.28	
4	企业债券	8,829,263.20	72.17
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换债(可交换债)	-	-
8	资产支持	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,482,382.60	91.36

7.6 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

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	122394	19中债国债	9,400	929,306.00	6.34
2	112830	11国债零息	20,200	826,000.00	7.24
3	122760	19国债逆回购	20,000	809,000.00	7.09
4	122769	19国债逆回购	20,000	809,200.00	7.01
5	122762	11国债逆回购	8,000	800,000.00	7.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

7.8 本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。

7.9 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

注:无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:无。

7.12 投资组合报告附注
7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。
7.12.2 本基金投资的前十名证券中,不存在投资于被中国证监会认定为欺诈发行、资金池的证券。
7.12.3 本基金投资的前十名证券中,不存在投资于被中国证监会认定为高风险证券的证券。
7.12.4 本基金投资的前十名证券中,不存在投资于被中国证监会认定为高风险证券的证券。
7.12.5 本基金投资的前十名证券中,不存在投资于被中国证监会认定为高风险证券的证券。

7.13 其他资产构成
注:无。

7.14 报告期末本基金持有的流通受限证券
7.14.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
注:无。

7.14.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
注:无。

7.14.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.14.3.1 银行间市场债券正回购
注:无。

7.14.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2018年06月30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1,200,000.00元,于2018年7月2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。

7.14.4 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
注:无。

8 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

8.1 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

8.2 报告期内,基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

8.3 报告期内,基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

8.4 报告期内,基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。