

基金管理人：南方基金管理有限公司
基金托管人：平安银行股份有限公司
报告送出日期：2017年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任个别基金经理负责。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，但不保证基金一定能盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，投资者在做出投资决策前应仔

细阅读本基金的招募说明书。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称 南方颐元债券型发起式

基金代码 002337

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2016年09月01日

报告期末基金份额总额 60,001,112,059

投资目标 在保持资产流动性良好的基础上，力求获得长期稳定的货币收益。

本基金综合运用信用评估模型、收益率曲线拟合、杠杆放大策略、货币市场基金支付凭证转换机制、中小企业私募债投资策略、新股申购投资策略等，并通过证券市场的投资、基金工具的丰富及交易方式的创新等，还将积极利用金融衍生品进行套利操作，从而在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的保值增值。

投资风格策略 中长期持有货币类投资收益。

本基金的长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金、债券基金，高于货币市场基金。

基金管理人 南方基金管理有限公司

基金托管人 平安银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 南方颐元债券型发起式 A 南方颐元债券型发起式 C

下属分级基金的交易代码 002337 003338

报告期末下属分级基金的份额总额 60,001,112,059份 0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“南方颐元”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2017年07月01日 - 2017年09月30日)
1.本期已实现收益	289,224,077
2.本期利润	794,036,068
3.加权平均基金份额本期利润	0.00773
4.期末基金资产净值	60,001,112,059
5.期末基金份额净值	1.0002

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.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将低于所列数字。

3.南方颐元C的份额成立至今尚未有申购赎回交易发生。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

份额期间	净值增长	收益率	业绩比较基准收益	差额	①-③	②-④
过去三个 月	0.71%	0.004%	-0.26%	0.03%	0.99%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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：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“南方颐元”。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

3.3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2017年07月01日 - 2017年09月30日)
1.本期已实现收益	29,409,016.43
2.本期利润	23,163,790.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0003
4.期末基金资产净值	2,006,001,110.40
5.期末基金份额净值	1.0004

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.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将低于所列数字。

3.南方颐元C的份额成立至今尚未有申购赎回交易发生。

3.2.3 基金净值表现

3.2.3.1 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.2 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.3 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.4 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.5 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.6 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.7 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.8 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.9 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.10 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.11 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.12 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.13 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.14 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.15 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.16 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.17 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.18 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.19 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.20 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.21 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.22 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.23 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.24 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.25 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.26 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.27 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.28 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.29 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.30 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.31 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.32 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.33 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.34 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.35 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.36 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.37 本报告期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

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“南方颐元”。

3.3.38 本报告期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