

南方丰元信用增强债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19日

1.1 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个别及连带责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表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,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益最低。基金的投资有风险,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。
本报告财务资料未经审计。
本报告自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

1.2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 南方丰元信用增强债券型证券投资基金; 交易代码, 000555; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日期, 2013年11月12日; 报告期末基金份额总额, 363,007,803.93; 投资策略, 本基金在严格控制风险的前提下,力争取得高于业绩比较基准的投资收益; 投资范围, 本基金在严格控制风险和流动性风险的前提下,力争取得高于业绩比较基准的投资收益; 业绩比较基准, 中国国债收益率; 风险收益特征, 本基金属于债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币基金; 基金管理人, 南方基金管理有限公司; 基金托管人, 中国工商银行股份有限公司; 下属基金的投资范围, 南方丰元信用增强债券型证券投资基金; 下属基金的基金代码, 000555; 基金管理人网址, 219,845,921.62; 基金管理人客服电话, 400,123,8877

1.3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日); 1.本期已实现收益, 7,346,688.25; 2.本期利润, 12,548,581.51; 3.期末基金份额净值, 0.9997; 4.期末基金资产净值, 236,148,346.93; 5.基金加权平均基金份额净收益, 1.05; 6.基金加权平均基金份额净收益增长率, 0.09%; 7.基金加权平均基金份额净收益增长率, 0.09%; 8.基金加权平均基金份额净收益增长率, 0.09%; 9.基金加权平均基金份额净收益增长率, 0.09%

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.本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。
3.2014年第二季度基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
南方丰元C

Table with 2 columns: 报告期, 2014年4月1日至2014年6月30日; 基金净值增长率, 0.09%; 业绩比较基准收益率, 0.09%; 基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差额, 0.00%; 基金净值增长率与业绩比较基准收益率的差额, 0.00%

注:基金合同生效以来基金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

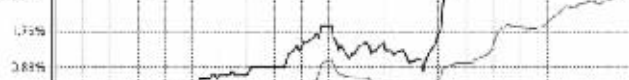
1.4 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



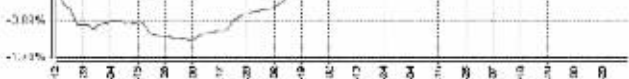
1.5 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



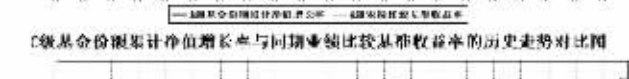
1.6 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.7 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.8 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



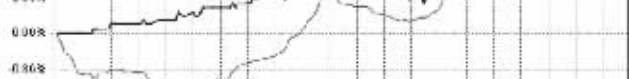
1.9 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



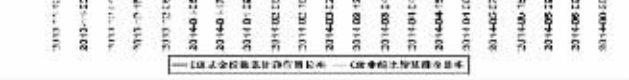
1.10 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



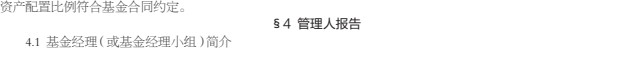
1.11 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



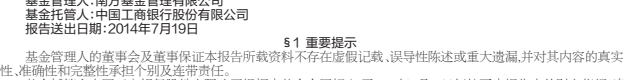
1.12 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



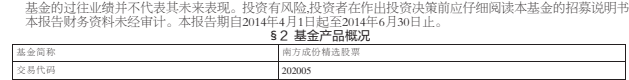
1.13 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.14 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



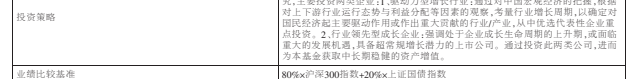
1.15 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



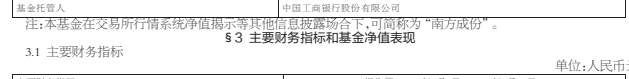
1.16 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.17 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



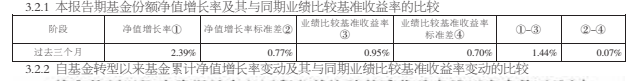
1.18 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.19 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



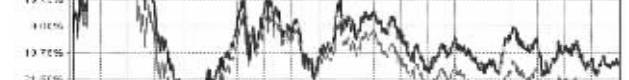
1.20 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



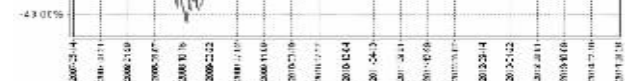
1.21 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.22 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.23 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.24 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



南方多利增强债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19日

1.1 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个别及连带责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表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,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益最低。基金的投资有风险,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。
本报告财务资料未经审计。
本报告自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

1.2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 南方多利增强债券型证券投资基金; 交易代码, 201022; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日期, 2009年8月28日; 报告期末基金份额总额, 2,021,521,544.270; 投资策略, 本基金在严格控制风险和流动性风险的前提下,力争取得高于业绩比较基准的投资收益; 投资范围, 本基金在严格控制风险和流动性风险的前提下,力争取得高于业绩比较基准的投资收益; 业绩比较基准, 中国国债收益率; 风险收益特征, 本基金属于债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币基金; 基金管理人, 南方基金管理有限公司; 基金托管人, 中国工商银行股份有限公司; 下属基金的投资范围, 南方多利增强债券型证券投资基金; 下属基金的基金代码, 201022; 基金管理人网址, 219,845,921.62; 基金管理人客服电话, 400,123,8877

1.3 主要财务指标和基金净值表现

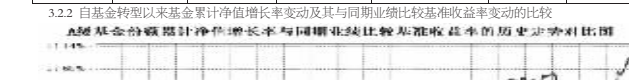
Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日); 1.本期已实现收益, 2,850,497.57; 2.本期利润, 3,619,897.87; 3.期末基金份额净值, 1.0025882547; 4.期末基金资产净值, 1,002,588,254.7; 5.基金加权平均基金份额净收益, 1.0794; 6.基金加权平均基金份额净收益增长率, 0.12%; 7.基金加权平均基金份额净收益增长率, 0.12%; 8.基金加权平均基金份额净收益增长率, 0.12%

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损益。
2.本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.本基金自2009年9月23日起增加A类收费模式,原有收费模式称为C类。

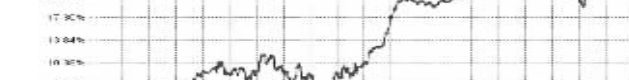
1.4 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.5 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.6 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



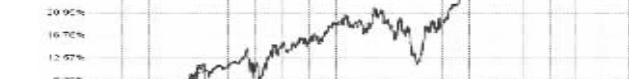
1.7 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.8 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



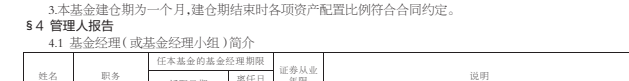
1.9 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



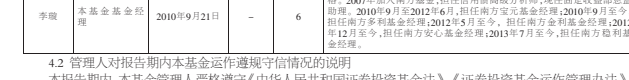
1.10 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



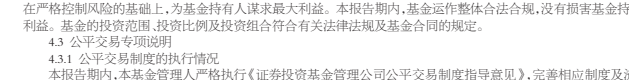
1.11 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



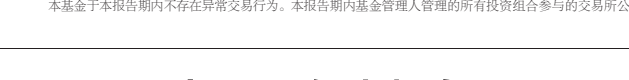
1.12 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.13 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.14 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



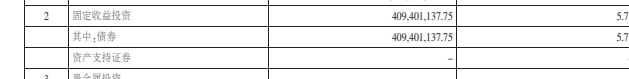
1.15 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



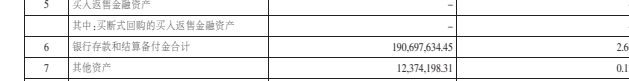
1.16 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



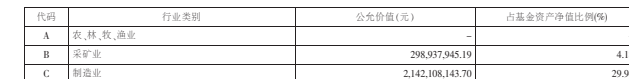
1.17 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



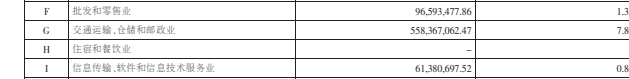
1.18 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



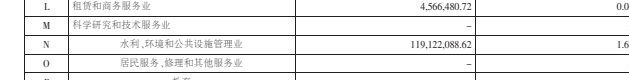
1.19 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



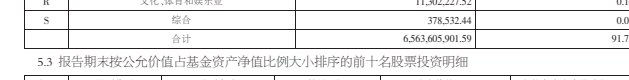
1.20 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



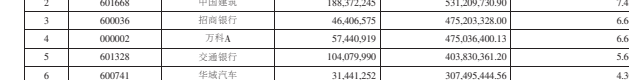
1.21 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



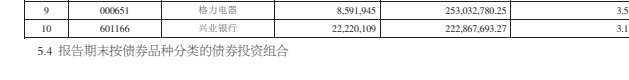
1.22 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



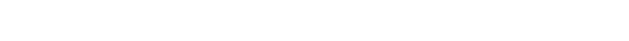
1.23 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.24 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.25 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19日

1.1 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个别及连带责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表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,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益最低。基金的投资有风险,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。
本报告财务资料未经审计。
本报告自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

1.2 基金产品概况

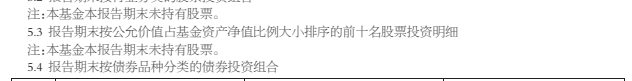
Table with 2 columns: 基金名称, 南方多利增强债券型证券投资基金; 交易代码, 201022; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日期, 2009年8月28日; 报告期末基金份额总额, 2,021,521,544.270; 投资策略, 本基金在严格控制风险和流动性风险的前提下,力争取得高于业绩比较基准的投资收益; 投资范围, 本基金在严格控制风险和流动性风险的前提下,力争取得高于业绩比较基准的投资收益; 业绩比较基准, 中国国债收益率; 风险收益特征, 本基金属于债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币基金; 基金管理人, 南方基金管理有限公司; 基金托管人, 中国工商银行股份有限公司; 下属基金的投资范围, 南方多利增强债券型证券投资基金; 下属基金的基金代码, 201022; 基金管理人网址, 219,845,921.62; 基金管理人客服电话, 400,123,8877

1.3 主要财务指标和基金净值表现

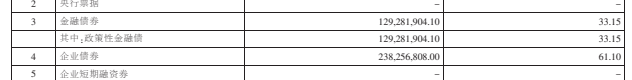
Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日); 1.本期已实现收益, 2,850,497.57; 2.本期利润, 3,619,897.87; 3.期末基金份额净值, 1.0025882547; 4.期末基金资产净值, 1,002,588,254.7; 5.基金加权平均基金份额净收益, 1.0794; 6.基金加权平均基金份额净收益增长率, 0.12%; 7.基金加权平均基金份额净收益增长率, 0.12%; 8.基金加权平均基金份额净收益增长率, 0.12%

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损益。
2.本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.本基金自2009年9月23日起增加A类收费模式,原有收费模式称为C类。

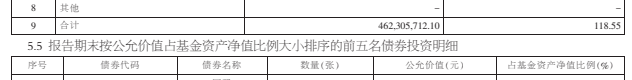
1.4 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.5 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



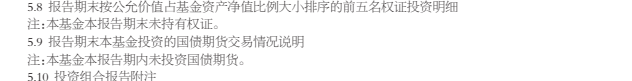
1.6 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



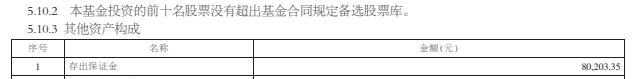
1.7 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



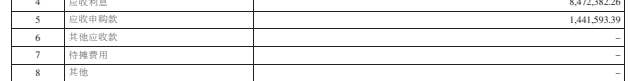
1.8 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



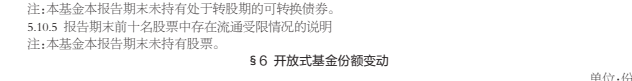
1.9 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



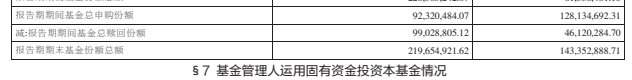
1.10 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



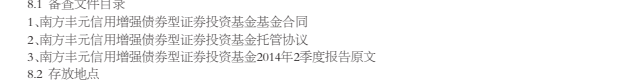
1.11 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.12 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.13 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.14 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.15 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.16 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



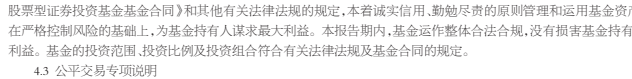
1.17 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



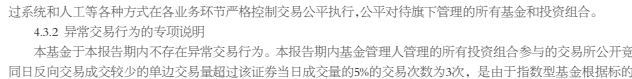
1.18 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



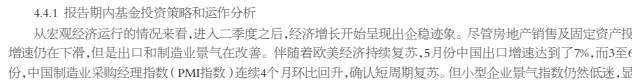
1.19 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



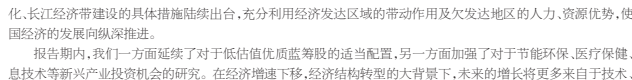
1.20 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



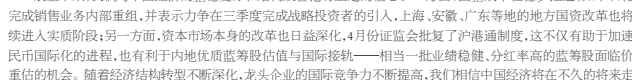
1.21 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



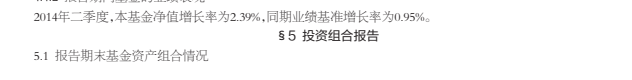
1.22 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



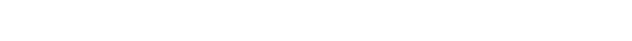
1.23 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.24 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.25 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19日

1.1 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个别及连带责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表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,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益最低。基金的投资有风险,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。
本报告财务资料未经审计。
本报告自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

1.2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 南方多利增强债券型证券投资基金; 交易代码, 201022; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日期, 2009年8月28日; 报告期末基金份额总额, 2,021,521,544.270; 投资策略, 本基金在严格控制风险和流动性风险的前提下,力争取得高于业绩比较基准的投资收益; 投资范围, 本基金在严格控制风险和流动性风险的前提下,力争取得高于业绩比较基准的投资收益; 业绩比较基准, 中国国债收益率; 风险收益特征, 本基金属于债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币基金; 基金管理人, 南方基金管理有限公司; 基金托管人, 中国工商银行股份有限公司; 下属基金的投资范围, 南方多利增强债券型证券投资基金; 下属基金的基金代码, 201022; 基金管理人网址, 219,845,921.62; 基金管理人客服电话, 400,123,8877

1.3 主要财务指标和基金净值表现

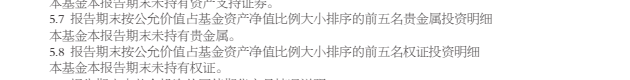
Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日); 1.本期已实现收益, 2,850,497.57; 2.本期利润, 3,619,897.87; 3.期末基金份额净值, 1.0025882547; 4.期末基金资产净值, 1,002,588,254.7; 5.基金加权平均基金份额净收益, 1.0794; 6.基金加权平均基金份额净收益增长率, 0.12%; 7.基金加权平均基金份额净收益增长率, 0.12%; 8.基金加权平均基金份额净收益增长率, 0.12%

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损益。
2.本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.本基金自2009年9月23日起增加A类收费模式,原有收费模式称为C类。

1.4 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.5 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.6 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较