

## 南方益和保本混合型证券投资基金

### 2018 第二季度报告

2018年6月30日

基金管理人:南方基金基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告截止日期:2018年6月30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个别及连带责任。

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7月16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,保证其中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本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预示其未来业绩,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。

本报告期指2018年4月1日起至2018年6月30日止。

**5.2 报告期期末资产分类构成情况**

注:本基金期末持有的全部金融资产投资

代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	应收利息、应收股利	-	-
B	银行存款	-	-
C	债券投资	178,143,847.28	72.3
D	权益投资	2,038,298.85	0.8
E	其他权益投资	9,253,323.09	3.8
F	期货及衍生品	31,454,116.22	13.0
G	买入返售金融资产	16,985,919.96	6.9
H	其他资产	-	-
I	待摊费用	-	-
J	递延所得税资产	77,387,652.95	32.0
K	其他金融资产	9,896,019.08	4.0
L	其他非金融资产	4,019,800.00	1.7
M	持有待售金融资产	-	-
N	其他	81,226.14	0.0
O	其他非流动资产	-	-
P	其他	-	-
Q	其他	-	-
R	其他	-	-
S	其他	-	-
T	其他	-	-
合计		315,963,280.04	13.0

**5.3 主要财务指标和基金净值表现**

主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	21,772,979.89	
2.本期利润	-2,125,281.94	
3.本期公允价值变动收益	-6,639.01	
4.加权平均基金份额本期利润	0.0087	
5.期末基金份额净值	2.417,969,996.34	
6.期末基金资产净值	1,081	
7.期末基金份额持有人数量	1,081	

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公允价值变动收益。

2.期末基金份额净值指期末基金份额净值,基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数所得的数值。

3.1.2 本基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期比较业绩收益率的比较

基金名称	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
本基金	-0.09%	0.16%	0.75%	0.09%	-0.84%	0.15%



注:1.本基金建仓期为六个月,建仓期间各项资产仓位符合合同约定;2.本基金的第一个保本周期为三年,自2014年1月1日至2019年1月1日止。

**4.1 基金经理(或基金经理小组)简介**

姓名	职务	任本基金基金经理期限	证券从业年限	说明
张永强	基金经理	2016年11月1日	15年	南方大学商学院金融学硕士,曾任南方基金研究员,2011年加入南方基金,历任南方基金研究员、基金经理助理,2016年11月1日起任南方基金益和保本混合型证券投资基金基金经理。2018年1月1日起任南方基金益和保本混合型证券投资基金基金经理。

注:1.对基金经理的任命,须经基金管理人“提名日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据合同约定确定的解聘日期,对此的非责任基金经理,“提名日期”和“离任日期”分别指前次和后一次基金管理人聘任的日期。

2.基金经理的任免须经基金管理人董事会审议通过并履行信息披露义务。

3.基金经理的任免须经基金管理人董事会审议通过并履行信息披露义务。

4.基金经理的任免须经基金管理人董事会审议通过并履行信息披露义务。

基金管理人:南方基金基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告截止日期:2018年6月30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个别及连带责任。

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7月16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,保证其中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本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预示其未来业绩,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。

本报告期指2018年4月1日起至2018年6月30日止。

**5.2 基金产品概况**

基金名称	南方亚洲美元收益债(QDII)
基金代码	00240
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2014年5月9日
投资目标	本基金投资于亚洲区域主权和准主权的固定收益资产以及发展中国家的股票,寻找具有成长性的投资标的,在追求基金资产长期增值的基础上,力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。在资产配置方面,本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。在个股选择方面,本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。
业绩比较基准	美元一年定期存款利率+1.2%
风险等级	本基金为债券基金,属于证券投资基金中的中低风险品种,预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	南方基金基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

**3.1 主要财务指标**

主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	1,938,290.96	
2.本期利润	71,712,286.41	
3.本期公允价值变动收益	6,639.01	
4.加权平均基金份额本期利润	0.0087	
5.期末基金份额净值	1,792,648,714.04	
6.期末基金资产净值	1,081	
7.期末基金份额持有人数量	1,081	

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公允价值变动收益。

2.期末基金份额净值指期末基金份额净值,基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数所得的数值。

3.1.2 本基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期比较业绩收益率的比较

基金名称	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
本基金	3.91%	0.22%	0.66%	0.08%	3.4%	0.22%



注:1.对基金经理的任命,须经基金管理人“提名日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据合同约定确定的解聘日期,对此的非责任基金经理,“提名日期”和“离任日期”分别指前次和后一次基金管理人聘任的日期。

基金管理人:南方基金基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告截止日期:2018年6月30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个别及连带责任。

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7月16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,保证其中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本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预示其未来业绩,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。

本报告期指2018年4月1日起至2018年6月30日止。

**5.2 基金产品概况**

基金名称	南方亚洲美元收益债(QDII)
基金代码	00240
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2014年5月9日
投资目标	本基金投资于亚洲区域主权和准主权的固定收益资产以及发展中国家的股票,寻找具有成长性的投资标的,在追求基金资产长期增值的基础上,力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。在资产配置方面,本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。在个股选择方面,本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。
业绩比较基准	美元一年定期存款利率+1.2%
风险等级	本基金为债券基金,属于证券投资基金中的中低风险品种,预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	南方基金基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

**3.1 主要财务指标**

主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	1,938,290.96	
2.本期利润	71,712,286.41	
3.本期公允价值变动收益	6,639.01	
4.加权平均基金份额本期利润	0.0087	
5.期末基金份额净值	1,792,648,714.04	
6.期末基金资产净值	1,081	
7.期末基金份额持有人数量	1,081	

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公允价值变动收益。

2.期末基金份额净值指期末基金份额净值,基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数所得的数值。

3.1.2 本基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期比较业绩收益率的比较

基金名称	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
本基金	3.91%	0.22%	0.66%	0.08%	3.4%	0.22%



注:1.对基金经理的任命,须经基金管理人“提名日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据合同约定确定的解聘日期,对此的非责任基金经理,“提名日期”和“离任日期”分别指前次和后一次基金管理人聘任的日期。

基金管理人:南方基金基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告截止日期:2018年6月30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个别及连带责任。

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7月16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,保证其中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本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预示其未来业绩,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。

本报告期指2018年4月1日起至2018年6月30日止。

**5.2 基金产品概况**

基金名称	南方亚洲美元收益债(QDII)
基金代码	00240
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2014年5月9日
投资目标	本基金投资于亚洲区域主权和准主权的固定收益资产以及发展中国家的股票,寻找具有成长性的投资标的,在追求基金资产长期增值的基础上,力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。在资产配置方面,本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。在个股选择方面,本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。
业绩比较基准	美元一年定期存款利率+1.2%
风险等级	本基金为债券基金,属于证券投资基金中的中低风险品种,预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	南方基金基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

**3.1 主要财务指标**

主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	1,938,290.96	
2.本期利润	71,712,286.41	
3.本期公允价值变动收益	6,639.01	
4.加权平均基金份额本期利润	0.0087	
5.期末基金份额净值	1,792,648,714.04	
6.期末基金资产净值	1,081	
7.期末基金份额持有人数量	1,081	

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公允价值变动收益。

2.期末基金份额净值指期末基金份额净值,基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数所得的数值。

3.1.2 本基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期比较业绩收益率的比较

基金名称	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
本基金	3.91%	0.22%	0.66%	0.08%	3.4%	0.22%



注:1.对基金经理的任命,须经基金管理人“提名日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据合同约定确定的解聘日期,对此的非责任基金经理,“提名日期”和“离任日期”分别指前次和后一次基金管理人聘任的日期。

## 南方颐元定期开放债券型发起式证券投资基金

### 2018 第二季度报告

2018年6月30日

基金管理人:南方基金基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告截止日期:2018年6月30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个别及连带责任。

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7月16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,保证其中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本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预示其未来业绩,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。

本报告期指2018年4月1日起至2018年6月30日止。

**5.2 基金产品概况**

基金名称	南方颐元定期开放债券型发起式基金
基金代码	001857
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2016年06月07日
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,力争获得长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。在资产配置方面,本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。在个股选择方面,本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险等级	本基金为债券基金,属于证券投资基金中的低风险品种,预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	南方基金基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

**3.1 主要财务指标**

主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	15,663,411.27	
2.本期利润	266,863,874.74	
3.本期公允价值变动收益	4,696.00	
4.加权平均基金份额本期利润	0.0087	
5.期末基金份额净值	2,037,328,075.56	
6.期末基金资产净值	1,024	
7.期末基金份额持有人数量	1,024	

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公允价值变动收益。

2.期末基金份额净值指期末基金份额净值,基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数所得的数值。

3.1.2 本基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期比较业绩收益率的比较

基金名称	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
本基金	1.45%	0.08%	0.27%	0.08%	1.08%	-0.01%



注:1.对基金经理的任命,须经基金管理人“提名日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据合同约定确定的解聘日期,对此的非责任基金经理,“提名日期”和“离任日期”分别指前次和后一次基金管理人聘任的日期。

基金管理人:南方基金基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告截止日期:2018年6月30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个别及连带责任。

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7月16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,保证其中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本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预示其未来业绩,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。

本报告期指2018年4月1日起至2018年6月30日止。

**5.2 基金产品概况**

基金名称	南方颐元定期开放债券型发起式基金
基金代码	001857
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2016年06月07日
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,力争获得长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。在资产配置方面,本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。在个股选择方面,本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险等级	本基金为债券基金,属于证券投资基金中的低风险品种,预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	南方基金基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

**3.1 主要财务指标**

主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	15,663,411.27	
2.本期利润	266,863,874.74	
3.本期公允价值变动收益	4,696.00	
4.加权平均基金份额本期利润	0.0087	
5.期末基金份额净值	2,037,328,075.56	
6.期末基金资产净值	1,024	
7.期末基金份额持有人数量	1,024	

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公允价值变动收益。

2.期末基金份额净值指期末基金份额净值,基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数所得的数值。

3.1.2 本基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期比较业绩收益率的比较

基金名称	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
本基金	1.45%	0.08%	0.27%	0.08%	1.08%	-0.01%



注:1.对基金经理的任命,须经基金管理人“提名日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据合同约定确定的解聘日期,对此的非责任基金经理,“提名日期”和“离任日期”分别指前次和后一次基金管理人聘任的日期。

基金管理人:南方基金基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告截止日期:2018年6月30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个别及连带责任。

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7月16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,保证其中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本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预示其未来业绩,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。

本报告期指2018年4月1日起至2018年6月30日止。

**5.2 基金产品概况**

基金名称	南方颐元定期开放债券型发起式基金
基金代码	001857
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2016年06月07日
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,力争获得长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。在资产配置方面,本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。在个股选择方面,本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险等级	本基金为债券基金,属于证券投资基金中的低风险品种,预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	南方基金基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

**3.1 主要财务指标**

主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	15,663,411.27	
2.本期利润	266,863,874.74	
3.本期公允价值变动收益	4,696.00	
4.加权平均基金份额本期利润	0.0087	
5.期末基金份额净值	2,037,328,075.56	
6.期末基金资产净值	1,024	
7.期末基金份额持有人数量	1,024	

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公允价值变动收益。

2.期末基金份额净值指期末基金份额净值,基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数所得的数值。

3.1.2 本基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期比较业绩收益率的比较

基金名称	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
本基金	1.45%	0.08%	0.27%	0.08%	1.08%	-0.01%



注:1.对基金经理的任命,须经基金管理人“提名日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据合同约定确定的解聘日期,对此的非责任基金经理,“提名日期”和“离任日期”分别指前次和后一次基金管理人聘任的日期。

基金管理人:南方基金基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告截止日期:2018年6月30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个别及连带责任。

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7月16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,保证其中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本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预示其未来业绩,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。

本报告期指2018年4月1日起至2018年6月30日止。

**5.2 基金产品概况**

基金名称	南方颐元定期开放债券型发起式基金
基金代码	001857
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2016年06月07日
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,力争获得长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。在资产配置方面,本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。在个股选择方面,本基金采取自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险等级	本基金为债券基金,属于证券投资基金中的低风险品种,预期收益和风险高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	南方基金基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司