南方产业活力股票型证券投资基金 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:中国银行股份有限公司
送出日期:2018年08月27日

§1 重要提示

1.1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年07月21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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

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

基金名称	南方产业活力股票型证券投资基金
基金简称	南方产业活力股票
基金主代码	000065
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月27日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,075,716,386.74份
基金合同存续期	不定期

注:本基金在交易所行情系统序号其他信息发布场合下,可简称为“南方产业活力”。

2.2 基金投资目标

投资目标	以上市公司基本面研究作为基础,通过专业化研究分析,积极挖掘符合产业发展趋势的行业和企业所蕴含的投资机会,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势。评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,积极合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争获得组合的超额增值。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	王永民
	联系电话	0755-82763888	010-66594896
	电子邮箱	manager@southernfund.com	ksd@bankofchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95566
传真		0755-82763889	010-66594942
注册地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		张海波	陈四清

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
登载基金年年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层

§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-2018年06月30日)
本期已实现收益	-69,768,799.18
本期利润	-108,493,734.79
加权平均基金份额本期利润	-0.0966
本期加权平均净值利润率	-8.29%
本期基金份额净值增长率	-9.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配利润	-75,446,061.54
期末可供分配基金份额利润	-0.0701
期末基金资产净值	1,137,099,856.89
期末基金份额净值	1.057
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)
基金份额累计净值增长率	5.70%

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.期末可供分配利润,采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)。

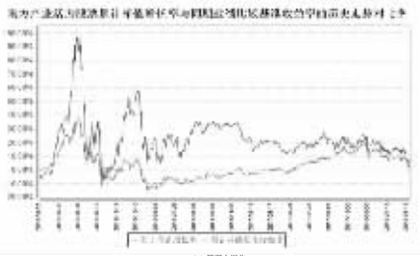
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.77%	1.53%	-6.07%	1.03%	-1.70%	0.50%
过去三个月	-9.74%	1.28%	-7.70%	0.91%	-2.04%	0.37%
过去六个月	-9.19%	1.38%	-9.93%	0.92%	0.64%	0.46%
过去一年	-11.84%	1.33%	-2.64%	0.76%	-9.20%	0.57%
过去三年	-28.53%	2.08%	-14.81%	1.19%	-13.72%	0.89%
自基金合同生效起至今	5.70%	2.14%	1.99%	1.28%	3.71%	0.86%

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



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日,经中国证监会批准,南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立,成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018年1月,公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司,注册资本金3亿元人民币。目前股权结构:华泰证券股份有限公司46%,深圳市投资控股有限公司30%,厦门国际信托有限公司15%及外资证券股份有限公司10%。目前,公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司,在香港和美国纽约设有子公司——南方东英资产管理有限公司(南方东英)和南方资本管理有限公司(美国子公司),其中,南方东英是境内基金公司跨境成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末,南方基金管理股份有限公司(不含子公司)管理资产规模近7,800亿元,旗下管理167只开放式基金,多个全国社保、基本养老保险、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张旭	本基金基金经理	2015年1月27日	-	9	中山大学金融学博士学位,注册会计师(CPA),具有基金从业资格。2008年加入南方基金,曾任金融及地产行业研究员、高级策略研究员。南方盛元基金经理助理(2012年3月至2014年12月),任南方消费基金经理;2012年11月至今,任南方盛元基金经理;2015年1月至今,任南方产业活力基金经理;2016年8月至今,任南方转型混合基金经理。
汪经全	本基金基金经理助理	2017年6月15日	-	3	清华大学物理学专业博士,具有基金从业资格。2014年7月加入南方基金,历任物理研究员、研究员、负责传媒行业研究。2017年5月至今,任南方盛元、南方产业活力、南方转型混合基金经理助理。

注:1.对基金的任职基金经理,表“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,中国证监会和《南方产业活力股票型证券投资基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公司每季度对旗下所有投资组合的交易价格、交易时间等情况进行抽查,检查公平性。报告期内,两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入价差均值或卖出价差均值超者不为0的情况不存在,并且交易比例比应有时段环境,未发现不公平利益外溢的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金下无报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单次交易量均未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年,A股市场先抑后扬,整体经历了较为明显的下跌,报告期内上证指数下跌13.9%。市场风格也经历较为明显的轮动,整体来看与经济周期关性较强的周期性板块跑赢,医药、食品饮料等超额跑赢,而对较为明显的市场环境,本基金密切跟踪市场环境,及时调整组合结构,在保持一定风险敞口的前提下,通过积极的个股选择,以期为持有人获取超额收益。

一方面坚持挖掘选具有长期竞争优势的低估值龙头企业,另一方面精选与国家战略转型方向相契合的优质科技成长企业和消费类企业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内,基金收益率为-9.19%,业绩基准收益率为-9.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望说明

报告期内国内经济发展平稳,PMI维持在荣枯线以上,但固定资产投资、社会消费品零售总额等投资和消费数据有所下滑,外部环境上,美国挑起的贸易摩擦引发了市场对国内经济发展趋势的担忧。国内货币政策呈现逆周期的特点,一方面对冲贸易摩擦的持续下滑,引发了市场对货币宽松的担忧;一方面为防止资产泡沫的膨胀,在经济稳定的前提下,通过窗口指导、提高超额存款准备金率等方式,对市场流动性进行了较大幅度的调整。市场的逻辑是在做排除法,国内在面对美和欧的板块资金撤出,比如资金寒集结于豆、铝等战略和未来行业,股东层面或配资比例较高的公司,调整无序明显。另一方面,宏观调控性较强的消费、医药类受益于内需政策的稳定性。当前A股整体估值水平处于历史较低水平,长期投资吸引力日趋明显。我们相信中国经济有着强劲的韧性和充足的政策回旋余地,恐慌情绪释放过后,伴随着改革红利的释放,优秀的民营企业仍将获得持续成长。外部环境的变化使我们更加清晰认识到国内市场引入的内需和不断提高的科技自主创新能力拓展投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则,中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值程序和估值原则进行内部分级管理制度,明确基金估值的程序和技术;建立了估值委员会,组成人员包括总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、固定收益部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用证券估值业务系统,估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中的信息披露,按照相关法律法规、基金管理人内发估值技术,导致基金资产净值的变化在0.25%以上的,对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每份基金份额分配次数最多为12次,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%,若(基金合同)生效不满3个月可不进行收益分配;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;因基金收益分配基准日的基金份额收益扣除情况计算出的基金份额应占期末可供分配利润比例,本报告期末基金未有分配事项。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本报告期未基金未有分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在南方产业活力股票型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全履职履尽勤勉尽责的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中所披露的财务数据、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:南方产业活力股票型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.1	16,916,194.50	15,067,264.28
结算备付金		13,277,061.24	8,913,530.67
存出保证金		526,990.08	630,357.59
交易性金融资产	6.4.2	1,004,749,125.70	1,330,846,995.18
其中:股票投资		914,048,542.30	1,239,127,595.18
基金投资		-	-
债券投资		90,700,583.40	91,718,400.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4	100,000,000.00	120,000,000.00
应收证券清算款		7,083,829.69	9,574,399.22
应收利息	6.4.5	3,070,729.77	1,432,229.18
应收股利		-	-
应收申购款		583,611.12	426,127.17
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,146,207,532.10	1,486,879,903.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		365,992.88	6,892,367.57
应付赎回款		3,681,049.53	1,799,933.50
应付管理人报酬		1,474,079.81	1,945,016.55
应付托管费		245,679.97	324,169.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6	3,172,276.43	2,616,645.25
应交税费		29.06	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7	198,567.54	397,424.78
负债合计		9,107,675.21	13,975,557.08
所有者权益:			
实收基金	6.4.8	1,075,716,386.74	1,266,313,833.95
未分配利润	6.4.9	61,383,470.15	207,590,512.17
所有者权益合计		1,137,099,856.89	1,472,904,346.12
负债和所有者权益总计		1,146,207,532.10	1,486,879,903.20

6.2 利润表

会计主体:南方产业活力股票型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	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		-85,164,139.19	9,113,776.63
1.利息收入		3,037,021.38	3,610,837.30
其中:存款利息收入	6.4.10	179,236.46	324,687.02
债券利息收入		1,594,146.40	1,745,406.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,263,638.52	1,540,743.82
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-49,681,269.46	-102,469,215.88
其中:股票投资收益	6.4.11	-58,885,490.06	-110,822,370.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.12	404,687.17	89,601.96
资产支持证券投资收益	6.4.12.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.13	-	-
衍生工具收益	6.4.14	-	-
股利收益	6.4.15	8,799,567.43	8,273,562.71
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.16	-38,724,935.61	107,444,594.27
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.17	206,040.50	517,560.94
减:二、费用		23,329,595.60	28,333,831.04
1. 管理人报酬	6.4.7.1.1	9,833,518.46	16,154,915.37
2. 托管费	6.4.7.1.2	1,638,919.73	2,692,485.89
3. 销售服务费	6.4.7.1.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.11	11,630,749.24	9,256,470.90
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3.11	-
7. 其他费用	6.4.7.19	226,405.06	230,958.88
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-108,493,734.79	-19,220,054.41
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-108,493,734.79	-19,220,054.41

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方产业活力股票型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	1,266,313,833.95	207,590,512.17	1,472,904,346.12
二.本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	-108,493,734.79	-108,493,734.79
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-189,597,447.21	-37,713,307.23	-227,310,754.44
其中:1.基金申购款	51,187,398.26	7,937,909.96	59,125,308.22
2.基金赎回款	-240,784,845.47	-45,651,217.19	-286,436,062.66
四.本期向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)	1,075,716,386.74	61,383,470.15	1,137,099,856.89

项目	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	1,917,592,838.88	398,548,467.86	2,316,141,306.74
二.本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	-19,220,054.41	-19,220,054.41
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-193,940,294.89	-36,549,561.22	-230,489,856.21
其中:1.基金申购款	119,292,774.06	21,204,520.59	140,497,294.65
2.基金赎回款	-313,233,068.95	-57,754,081.81	-370,987,150.76
四.本期向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)	1,723,652,543.99	342,779,852.23	2,066,431,406.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告表6.5至6.6财务报表由下列负责人签署:

杨小松	徐超	徐超
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 本期重要会计差错

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》,财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》,财税[2016]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》,财税[2016]46号《关于进一步明确金融机构资产管理业务税收政策的通知》,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《关于明确金融机构资产管理和信托业有关增值税政策的通知》,财税[2017]2号《关于资管产品增值税有关问题的补充通知》,财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》,财税[2017]90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)货物产品应税销售收入的增值税按17%,以销售产品所得入为销项税额。对货物产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未抵扣增值税的,不再追溯;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股票的转让收入免征增值税,对金融同业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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货币期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货币期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票的差价收入、股票的股息、红利收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(c)对基金从上市公司取得的股息红利所得,按股权限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;按股权限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;按股权限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额,上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(d)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(e)本基金的城市维护建设税、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 重要财务报表项目的说明

6.4.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
活期存款	16,916,194.50
定期存款	-
其中:存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月及以上	-
其他存款	-
合计	16,916,194.50

6.4.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2018年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		925,762,245.74	914,048,542.30	-11,713,703.44
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	666,000.00	682,583.40	16,583.40
	银行间市场	89,891,310.00	90,018,000.00	126,690.00
	合计	90,557,310.00	90,700,583.40	143,273.40
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,016,319,555.74	1,004,749,125.70	-11,570,430.04

6.4.3 衍生金融资产/负债

注:无。

6.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	
	账面金额	其中:买断式逆回购
交易所市场	100,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	100,000,000.00	-

6.4.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	3,144.53
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5,377.23
应收债券利息	3,090,098.54
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-28,104.11
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	213.48
合计	3,070,729.77

6.4.6 其他资产

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,172,276.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,172,276.43

6.4.7 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付赎回费	2,692.96
预提费用	196,874.58
合计	198,567.54

6.4.8 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,266,313,833.95	1,266,313,833.95
本期申购	51,187,398.26	51,187,398.26
本期赎回(以“-”号填列)	-240,784,845.47	-240,784,845.47
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,075,716,386.74	1,075,716,386.74

注:申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额

6.4.9 未分配利润

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,219,494.08	212,810,006.25	207,590,512.17
本期利润	-69,768,799.18	-38,724,935.61	-108,493,734.79
本期基金份额交易产生的变动数	-457,768.28	-37,255,538.95	-37,713,307.23
其中:基金申购款	14,712.52	7,923,197.44	7,937,909.96
基金赎回款	-472,480.80	-45,179,736.39	-45,651,217.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-75,446,061.54	136,829,531.69	61,383,470.15

6.4.10 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
活期存款利息收入	79,485.59
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	95,496.75
其他	4,254.12
合计	179,236.46

6.4.11 股票投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
卖出股票成交总额	3,954,315,775.25
减:卖出股票成本总额	4,013,201,265.31
买卖股票差价收入	-58,885,490.06

6.4.12 债券投资收益

6.4.12.1 债券投资收益项目构成

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	404,687.17
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	404,687.17

6.4.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	2,573,513.43
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	2,168,400.00
减:应收利息总额	466.26
买卖债券差价收入	404,687.17

6.4.12.3 资产支持证券投资收益

注:无。

6.4.13 贵金属投资收益

注:无。

6.4.14 衍生工具收益

注:无。

6.4.15 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,799,567.43
合计	8,799,567.43

6.4.16 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
1.交易性金融资产	-38,724,935.61
股票投资	-39,209,519.01
债券投资	484,583.40
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减:应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-38,724,935.61

6.4.17 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
基金赎回费收入	182,105.12
补差费行资产	22,935.38
合计	205,040.50

注:本基金场内部分的赎回费率为0.5%,场外部分的赎回费率按持有期间递减,不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.18 交易费用

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
交易所市场交易费用	11,630,749.24
银行间市场交易费用	-
合计	11,630,749.24

6.4.19 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
审计费用	47,108.87
信息披露费	148,765.71
账户维护费	9,000.00
银行费用	21,530.48
合计	226,405.06

6.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.5.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金并无须作披露的或有事项。

6.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.6 关联方关系

6.6.1 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。

6.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、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《南方基金管理有限公司此次名称变更的公告》,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。

6.6.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间无关联方交易。

6.6.7.1 关联方投资

6.6.7.1.1 基金管理费

单位:人民币元

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管理费	9,833,518.46	16,154,915.37
其中:支付销售机构的客户维护费	3,581,020.55	5,615,838.29

6.6.7.1.2 基金托管费

单位:人民币元

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	1,638,919.73	2,692,485.89

6.6.7.1.3 销售服务费

注:无。

6.6.7.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.6.7.3 各关联方投资本基金的情况

6.6.7.3.1 报告期内基金管理人运用所有资金投资本基金的情况

注:本基金本报告期内无基金管理人运用所有资金投资本基金的情况。

6.6.7.3.2 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:本基金本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.6.7.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日			
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	16,916,194.50	79,485.59	12,783,322.62	217,961.69

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行间市场利率计息。

6.6.7.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

6.6.7.6 其他关联交易事项的说明

无。

6.6.8 利润分配情况

注:无。

6.6.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.6.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.6.9.1.1 受限证券类别:股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位