南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金 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:中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年8月22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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

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	南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	南方创新经济灵活配置混合
基金主代码	001053
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月24日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,025,090,933.13份
基金合同存续期	不定期

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“南方创新经济”。

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下,通过专业化研究分析,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定增值。
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,对证券市场当期的系统性风险达发可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估。在整合智定主基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整期限和调整范围,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。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	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,高于债券基金、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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66106799
	电子邮箱	manager@nfcuthemfund.com	csustody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66106799

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
登载基金半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、基金托管人的办公地址

§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	30,167,433.58
本期利润	-50,026,500.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0466
本期加权平均净值利润率	-3.65%
本期基金份额净值增长率	-3.18%
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	222,097,175.26
期末可供分配基金份额利润	0.2167
期末基金资产净值	1,247,188,108.39
期末基金份额净值	1.217

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)。

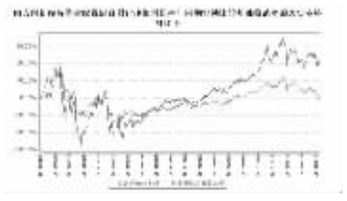
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-3.57%	1.46%	-4.46%	0.77%	0.89%	0.69%
过去三个月	-0.73%	1.18%	-5.43%	0.68%	4.70%	0.50%
过去六个月	-3.18%	1.25%	-6.72%	0.69%	3.54%	0.56%
过去一年	11.14%	1.07%	-1.09%	0.57%	12.23%	0.50%
过去三年	27.17%	1.53%	-8.16%	0.89%	35.33%	0.64%
自基金合同生效起至今	21.70%	1.54%	-0.43%	0.96%	22.13%	0.58%

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45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。目前,公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司,在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中,南方东英是境内基金公司获批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		
谢辉	本基金经理	2015年6月19日	-	8	北京大学西方经济学硕士,具有基金从业资格,金融分析师(CFA)资格,2009年7月加入南方基金,担任研究部研究员、高级研究员;2014年2月至2015年5月,任南方新优享基金经理助理;2015年5月至今,任南方新优享基金经理;2015年6月至今,任南方创新经济基金经理;2018年4月至今,任南方成安优选混合基金经理。
王天戈	本基金基金经理助理	2015年3月25日	-	11	南华大学化学工程与技术专业博士,具有基金从业资格,2007年4月加入南方基金,任研究部研究员、高级研究员,负责石油开采、基础化工、中小市值的行业研究。2016年3月至今,担任南方创新经济基金经理助理。

注: 1. 对基金的首任基金经理,其“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解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指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《南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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、投资比例及投资组合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,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。 公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内,两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在,并且交易占优比也没有明显异常,未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本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边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

上半年市场持续调整,仅餐饮旅游、食品饮料和医药三个行业录得正收益。创新经济基金在一季度表现不佳,二季度及时调整,通过配置消费和新兴成长领域的部分优质公司,取得了较大的超额收益,但仍未能实现绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长-3.18%,同期业绩比较基准增长-6.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前A股估值水平较低,从目前的经济数据观察,中国经济的韧性仍然很强,不大可能硬着陆,但贸易摩擦和去杠杆相关政策对经济的影响会比较长远。目前相关事件对风险溢价的冲击或已告一段落,但对于企业盈利的影响还没有充分显现,这是未来相当长一段时间内需要密切观察的风险点。行业层面,在消费行业中我们依旧看好食品饮料。无论是从公司定价权和商业模式角度、还是从行业景气角度,食品饮料相对其他消费品仍然具有明显的优势。 在新兴成长类行业中,我们认为创新药和云计算这两个板块长期空间较大,短期中报预告情况也不错,会继续保持紧密跟踪。

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和份额净值计价的业务管理制度,明确基金估值的程序和技术;建立了估值委员会,组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、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。本基金管理人使用可靠的估值业务系统,估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术,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;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;同一类别每一基金份额享有同等分配权;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。 根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本报告期本基金未有分配事项。

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, 本基金托管人在对南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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, 南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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:南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	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	70,287,237.30	147,583,377.05
结算备付金	32,171,407.34	31,196,511.56
存出保证金	851,838.07	947,853.20
交易性金融资产	1,014,578,914.44	1,031,775,037.61
其中:股票投资	926,622,137.44	963,369,078.11
基金投资	-	-
债券投资	87,956,777.00	78,415,959.50
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	180,000,000.00	100,000,000.00
应收证券清算款	1,653,083.40	16,852,494.06
应收利息	2,435,267.52	1,239,511.92
应收股利	-	-
应收申购款	306,789.41	123,060.15
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,302,284,537.48	1,329,717,825.55
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	49,079,686.81	1,375,285.18
应付赎回款	783,565.56	2,784,368.15
应付管理人报酬	1,586,694.02	1,669,803.13
应付托管费	264,449.01	278,300.49
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,187,872.27	3,223,464.62
应交税费	36.94	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	194,135.48	391,345.96
负债合计	55,096,429.09	9,722,567.53
所有者权益:		
实收基金	1,025,090,933.13	1,049,966,882.41
未分配利润	222,097,175.26	270,028,365.61
所有者权益合计	1,247,188,108.39	1,319,995,248.02
负债和所有者权益总计	1,302,284,537.48	1,329,717,825.55

注: 报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.217元,基金份额总额1,025,090,933.13份。

6.2 利润表

会计主体:南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日
一.收入	-27,043,686.97	202,320,931.61
1.利息收入	6,362,268.33	5,538,626.13
其中:存款利息收入	425,257.09	979,516.52
债券利息收入	1,379,817.33	3,282.14
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,557,193.91	4,555,857.47
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	46,112,967.26	118,690,393.18
其中:股票投资收益	38,771,003.11	113,733,690.33
基金投资收益	-	-
债券投资收益	206,347.74	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	7,135,616.50	4,956,702.85
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-80,193,933.88	77,896,080.99
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	675,011.23	195,831.31
减:二.费用	22,982,813.33	25,074,489.60
1. 管理人报酬	10,179,542.86	10,714,467.27
2. 托管费	1,696,590.49	1,785,742.85
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	10,902,962.20	12,375,173.54
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	3.86	-
7. 其他费用	203,713.92	199,115.94
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-50,026,500.30	177,246,442.01
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)	-50,026,500.30	177,246,442.01

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金

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)	1,049,966,882.41	270,028,365.61	1,319,995,248.02
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-50,026,500.30	-50,026,500.30
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)	-24,875,949.28	2,095,309.96	-22,780,639.32
其中:1.基金申购款	519,766,699.95	135,292,872.96	655,059,572.91
2.基金赎回款	-544,642,649.23	-133,197,563.01	-677,840,212.24
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)	1,025,090,933.13	222,097,175.26	1,247,188,108.39
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)	1,567,815,257.49	-47,536,906.04	1,520,278,351.45
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	177,246,442.01	177,246,442.01
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)	-269,372,492.06	-6,019,348.72	-275,391,837.80
其中:1.基金申购款	267,296,656.10	14,597,769.91	281,894,426.01
2.基金赎回款	-536,669,148.16	-20,617,118.63	-557,286,263.81
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)	1,298,442,765.41	123,690,190.26	1,422,132,955.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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 差错更正的说明

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[2015]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]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 教育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政策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)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日前运营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股票、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。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、非货物期货,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、非货物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、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(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20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在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;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过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。

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。

6.4.4 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》,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

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 债券交易

注:无。

6.4.5.1.3 债券回购交易

注:无。

6.4.5.1.4 权证交易

注:无。

6.4.5.1.5 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

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	10,179,542.86	10,714,467.27
其中:支付销售机构的客户维护费	1,806,338.74	3,396,088.57

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1.5%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 X 1.5% / 当年天数。

6.4.5.2.2 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	1,696,590.49	1,785,742.85

注:支付基金托管人 中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 X 0.25% / 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 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

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3月24日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	11,222,222.22	11,222,222.22
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	11,222,222.22	11,222,222.22
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.0948%	0.8643%

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:本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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

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
中国工商银行股份有限公司	70,287,237.30	168,067.67	96,130,809.81	787,536.63

注:本基金的银行活期存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.6 利润分配情况

注:无

6.4.7 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 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

6.4.9.1.1 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:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300713	英可瑞	2017-10-23	2018-11-01	锁定期股票	40.29	39.07	7,008.00	282,352.32	273,802.56	-
300713	英可瑞	2018-06-19	2018-11-01	锁定期股票	-	39.07	5,606.00	-	219,026.42	
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
600706	东方铁塔	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-

6.4.7.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注: 无

6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.7.3.1 银行间市场债券正回购

注:无

6.4.7.3.2 交易所市场债券正回购

无

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	926,622,137.44	71.15
	其中:股票	926,622,137.44	71.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	87,956,777.00	6.75
	其中:债券	87,956,777.00	6.75
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	180,000,000.00	13.82
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	102,458,644.64	7.87
8	其他各项资产	5,246,978.40	0.40
9	合计	1,302,284,537.48	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境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,074,186.00	0.09
C	制造业	685,867,258.61	54.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,103.85	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,460,949.00	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	11,516,403.00	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	97,743,727.27	7.84
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	66,970,653.63	5.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	46,271,759.94	3.71
R	文化、体育和娱乐业	8,612,870.00	0.69
S	综合	-	-
	合计	926,622,137.44	74.30

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002507	涪陵榨菜	1,828,910	46,966,406.80	3.77
2	000596	古井贡酒	445,079	39,514,113.62	3.17
3	600690	青岛海尔	1,981,200	38,157,912.00	3.06
4	002027	分众传媒	3,973,091	38,022,480.87	3.05
5	600519	贵州茅台	42,178	30,851,519.88	2.47
6	603369	口子窖	494,743	29,787,463.35	2.39
7	601888	中国国旅	449,436	28,948,172.76	2.32
8	002304	洋河股份	215,671	28,382,303.60	2.28
9	600486	扬农化工	499,600	27,942,628.00	2.24
10	600872	中炬高新	918,000	25,704,000.00	2.06

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于http://www.nffund.com的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603799	华友钴业	119,887,344.04	9.08
2	000651	格力电器	108,056,748.18	8.19
3	002027	分众传媒	81,243,872.67	6.15
4	600585	海螺水泥	79,865,649.87	6.05
5	601012	隆基股份	72,806,847.87	5.52
6	600690	青岛海尔	64,259,734.18	4.87
7	002236	大华股份	60,208,165.29	4.56
8	600519	贵州茅台	59,719,006.88	4.52
9	300618	寒锐钴业	58,151,067.25	4.41
10	000568	泸州老窖	56,959,620.41	4.32
11	601155	新城控股	56,599,151.69	4.29
12	600809	山西汾酒	56,991,154.87	4.24
13	600340	华夏幸福	56,984,089.01	4.24
14	002304	洋河股份	56,735,331.15	4.22
15	600887	伊利股份	53,368,600.13	4.04
16	601939	建设银行	47,776,238.97	3.62
17	600438	通威股份	46,423,070.71	3.52
18	300085	恒宝科技	42,405,066.47	3.21
19	600036	招商银行	40,134,416.72	3.04
20	300296	利亚德	39,188,198.40	2.97
21	000661	长春高新	37,816,719.17	2.86
22	600104	上汽集团	36,136,869.55	2.74
23	601601	中国太保	35,763,328.06	2.71
24	600872	中炬高新	35,572,464.35	2.69
25	600894	广船国际	34,810,859.41	2.64
26	002142	宁波银行	34,672,136.18	2.63
27	002078	太阳纸业	33,392,203.45	2.53
28	601888	中国国旅	32,943,733.19	2.50
29	000786	北新建材	32,152,604.15	2.44
30	600486	扬农化工	31,067,607.41	2.35
31	601111	中国国航	29,906,597.87	2.27
32	300671	富满微	29,899,128.29	2.27
33	000596	古井贡酒	29,636,453.57	2.25
34	600176	中国巨石	29,049,896.61	2.20
35	603369	今世缘	28,776,131.23	2.18
36	002138	顺络电子	28,112,038.86	2.13
37	300657	弘信电子	27,282,553.46	2.07
38	600030	中信证券