南方安享绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至06月30日止。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方安享绝对收益策略定期开放混合型发起式
基金主代码	002527
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年4月8日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	78,076,886.61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“南方安享绝对收益”。

2.2 基金产品说明

投资目标	灵活应用多种绝对收益策略对冲本基金的系统性风险,寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金力争通过合理判断市场走势,合理配置股票、股指期货、债券等投资工具的比例,通过定量和定性相结合的方法精选个股,并通过卖出股指期货合约对冲股票组合的市场风险,在尽量避免投资组合资产损失的前提下力争实现较为稳定的绝对回报。
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率(税后)+2%
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金,通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险,因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准,由于绝对收益策略投资结果的不确定性,因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	陆志俊
	联系电话	0755-82763888	95559
	电子邮箱	manager@southernfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-889-8899	95559
传真		0755-82763889	021-62701216

2.4 信息披露方式

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	2,441,348.56
本期利润	-3,697,473.05
加权平均基金份额本期利润	-0.0438
本期基金份额净值增长率	-4.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0511
期末基金资产净值	74,084,522.53
期末基金份额净值	0.9489

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。

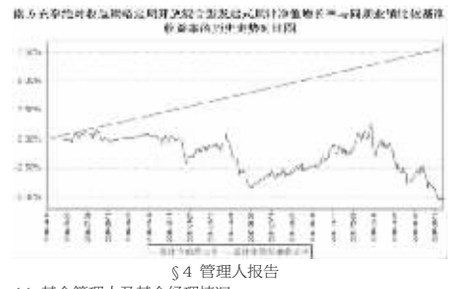
4.本基金自2017年6月7日起,基金份额净值由小数点后三位调整为小数点后四位。

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	-1.44%	0.20%	0.27%	0.01%	-1.71%	0.19%
过去三个月	-2.73%	0.29%	0.82%	0.01%	-3.55%	0.28%
过去六个月	-4.37%	0.34%	1.64%	0.01%	-6.01%	0.33%
过去一年	-1.89%	0.28%	3.36%	0.01%	-5.25%	0.27%
自基金合同生效起至今	-5.11%	0.23%	7.80%	0.01%	-12.91%	0.22%

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
罗文杰	本基金基金经理	2016年12月30日	-	13	女,美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士,具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行,从事量化分析工作。2008年9月加入南方基金,任南方基金数量化投资部基金经理助理。2013年4月起担任数量化投资部基金经理。现任指数投资部、数量化投资部总经理。2013年5月至2015年6月,任南方策略基金经理;2013年4月至今,任南方500、南方500ETF基金经理;2013年5月至今,任南方300、南方开元沪深300ETF基金经理;2014年10月至今,任500医药基金经理;2015年2月至今,任南方恒生ETF基金经理;2016年12月至今,任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理;2017年7月至今,任恒生联接基金经理;2017年8月至今,任南方房地产联接、南方房地产ETF基金经理;2017年11月至今,任南方策略、南方量化混合基金经理;2018年2月至今,任H股ETF、南方H股ETF联接基金经理;2018年4月至今,任MSCI基金基金经理;2018年6月至今,任MSCI联接基金经理。

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《南方安享绝对收益策略定期开放混合型发起式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,没有发生损害基金持有人利益的情形。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。公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析,对本报告期内,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、卖出溢价率、交易占优比等因素进行了综合分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

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

本基金本季度投资主要包括量化选股、对冲操作及交易所回购等现金管理。量化对冲部分投资由于市场个股波动率降低、股指期货的政策限制导致股票现货的选择范围不大,模型的超额收益受到了不小的影响。但我们也注意到,由于政策限制导致股指期货的流动性较差以及期货贴水的情况在逐渐的好转中。在对冲之外,我们也进行了交易所回购等操作,给基金贡献了部分的收益;另外报告期市场大幅调整,基金在对冲基础上有部分多头,此部分本季度贡献为负收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.9489元,报告期内,份额净值增长率为-4.37%,同期业绩基准增长率为1.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年上半年,受到中美贸易战下经济下行的悲观预期和去杠杆持续紧张对企业经营造成的负面冲击等影响,市场出现了震荡探底走势,年初至今经历三波下跌后市场风险得到较为充分的释放。展望下半年市场,权益市场整体无论是指数的估值或是板块的业绩估值性价比均反映出市场内在价值已经到了较优的配置区间,投资价值凸显。综合看,权益市场预期将有一个较好的表现。

对于本基金来说,近期期货基差贴水的状态已全面改善,且随着市场波动率的提升,以及股票间的收益表现分化,相信量化对冲产品将获得合理的回报,满足广大投资者的投资需求。

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;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

2018年上半年度,基金托管人在南方安享绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2018年上半年度,南方基金管理股份有限公司在南方安享绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

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

2018年上半年度,由南方基金管理股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关南方安享绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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:南方安享绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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	542,692.51	870,829.17
结算备付金	5,720,636.79	6,719,091.88
存出保证金	2,572,866.35	9,736,269.20
交易性金融资产	21,041,525.45	73,391,352.60
其中:股票投资	21,041,525.45	73,372,452.60
基金投资	-	-
债券投资	-	18,900.00
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	44,600,000.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	35,761.16	3,959.54
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	74,513,482.26	90,721,502.39
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	88,293.84	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	61,311.56	76,597.27
应付托管费	15,327.88	19,149.30
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	14,543.52	8,431.69
应交税费	73,938.27	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	175,544.66	164,000.00
负债合计	428,959.73	268,178.26
所有者权益:		
实收基金	78,076,886.61	91,155,208.77
未分配利润	-3,992,364.08	-701,884.64
所有者权益合计	74,084,522.53	90,453,324.13
负债和所有者权益总计	74,513,482.26	90,721,502.39

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.9489元,基金份额总额78,076,886.61份。

6.2 利润表

会计主体:南方安享绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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	-2,766,774.71	-3,403,148.39
1.利息收入	162,522.95	516,346.26
其中:存款利息收入	47,829.79	259,877.74
债券利息收入	1,495.43	16.83
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	113,197.73	256,451.69
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	3,195,248.61	-6,786,586.56
其中:股票投资收益	-2,628,760.96	-665,844.89
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,725.66	5,512.77
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	5,277,532.29	-6,894,540.00
股利收益	544,751.62	768,285.56
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-6,138,821.61	2,801,979.33
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	14,275.34	65,112.58
减:二、费用	930,698.34	1,614,226.57
1. 管理人报酬	411,603.39	819,148.59
2. 托管费	102,900.89	204,787.10
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	221,519.27	414,129.85
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	18,296.48	-
7. 其他费用	176,378.31	176,161.03
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-3,697,473.05	-5,017,374.96
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-3,697,473.05	-5,017,374.96

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方安享绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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)	91,155,208.77	-701,884.64	90,453,324.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,697,473.05	-3,697,473.05
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)	-13,078,322.16	406,993.61	-12,671,328.55
其中:1.基金申购款	15,605,433.18	73,041.39	15,678,474.57
2.基金赎回款	-28,683,755.34	333,952.22	-28,349,803.12
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)	78,076,886.61	-3,992,364.08	74,084,522.53
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)	210,010,407.10	-246,363.92	209,764,043.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,017,374.96	-5,017,374.96
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)	-65,766,005.82	538,781.47	-65,227,224.35
其中:1.基金申购款	126,044.10	-1,804.92	124,239.18
2.基金赎回款	-65,892,049.92	540,586.39	-65,351,463.53
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)	144,244,401.28	-4,724,957.41	139,519,443.87

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

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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。

(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。

6.4.4 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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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 权证交易

注:无。

6.4.5.1.3 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	411,603.39	819,148.59
其中:支付销售机构的客户维护费	109,448.33	289,129.70

注:1.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1.00%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 1.00% / 当年天数。

2.在符合基金收益分配条件的情况下,在提取评价日(每一个封闭期的最后一个工作日)计算并计提附加管理费,按照“新高法原则”提取超额收益的10%作为附加管理费,次月一次性支付。

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	102,900.89	204,787.10

注:支付基金托管人交通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4月8日)持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
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	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.8079%	6.9327%

注:基金管理人南方基金认购本基金的交易委托华泰证券办理,适用认购费为每笔1000元。

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:无。

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
交通银行股份有限公司	542,692.51	6,115.95	1,042,408.26	25,580.87

注:本基金由基金托管人交通银行保管的银行存款,按银行约定利率计息。

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 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大资产重组	6.00	-	-	15,000	84,446.98	90,000.00	-
000939	*ST凯迪	2017-11-16	重大事项	4.99	2018-07-02	4.74	12,800	71,942.65	63,872.00	-
002005	德豪润达	2018-01-02	重大资产重组	4.36	2018-07-02	3.92	10,600	50,675.00	46,216.00	-
002477	雏鹰农牧	2018-06-14	重大事项	3.31	-	-	64,900	251,669.05	214,819.00	-
300146	汤臣倍健	2018-01-31	重大资产重组	16.60	2018年7月31日	16.50	12,900	188,094.08	214,140.00	-
300324	旋极信息	2018-05-30	重大资产重组	9.49	-	-	24,988	307,147.71	237,136.12	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	10.64	-	-	800	12,952.00	8,512.00	-
601390	中国中铁	2018-05-07	重大资产重组	6.44	2018年8月20日	7.25	37,800	324,170.37	243,432.00	-

注:本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	21,041,525.45	28.24
	其中:股票	21,041,525.45	28.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	44,600,000.00	59.85
	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	6,263,329.30	8.41
8	其他各项资产	2,608,627.51	3.50
9	合计	74,513,482.26	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	236,505.00	0.32
B	采矿业	926,275.40	1.25
C	制造业	7,452,120.33	10.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,528.00	0.10
E	建筑业	939,415.60	1.27
F	批发和零售业	90,194.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	346,632.00	0.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	690,096.92	0.93
J	金融业	9,441,217.40	12.74
K	房地产业	795,140.80	1.07
L	租赁和商务服务业	34,192.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	18,208.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	21,041,525.45	28.40

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。

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	601318	中国平安	42,300	2,477,934.00	3.34
2	600519	贵州茅台	2,189	1,601,165.94	2.16
3	600036	招商银行	42,800	1,131,632.00	1.53
4	601166	兴业银行	51,700	744,480.00	1.00
5	600016	民生银行	98,000	686,000.00	0.93
6	600276	恒瑞医药	8,700	659,112.00	0.89
7	600887	伊利股份	23,200	647,280.00	0.87
8	601288	农业银行	156,900	539,736.00	0.73
9	600030	中信证券	30,700	508,699.00	0.69
10	601398	工商银行	88,500	470,820.00	0.64

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	600438	通威股份	2,951,909.00	3.26
2	601318	中国平安	2,284,508.00	2.53
3	600048	保利地产	2,150,136.00	2.38
4	600801	华新水泥	2,123,550.00	2.35
5	601233	桐昆股份	1,924,162.81	2.13
6	000002	万科A	1,913,534.00	2.12
7	002001	新和成	1,859,927.00	2.06
8	000786	北新建材	1,711,090.28	1.89
9	600176	中国巨石	1,473,839.00	1.63
10	600260	凯乐科技	1,375,911.06	1.52
11	600346	恒力股份	1,333,972.00	1.47
12	600338	西藏珠峰	1,324,906.72	1.46
13	603225	新凤鸣	1,291,968.40	1.43
14	600426	华鲁恒升	1,267,837.00	1.40
15	603877	太平鸟	1,220,643.00	1.35
16	601016	节能风电	1,193,570.20	1.32
17	300274	阳光电源	1,159,781.46	1.28
18	600366	宁波韵升	1,125,626.00	1.24
19	000830	鲁西化工	1,120,508.00	1.24
20	002583	海能达	1,106,274.00	1.22

注:买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	6,261,415.00	6.92
2	600801	华新水泥	2,919,922.62	3.23
3	600036	招商银行	2,772,966.00	3.07
4	600438	通威股份	2,560,685.70	2.83
5