南方新兴消费增长分级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。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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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2018年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方新兴消费增长分级股票		
场内简称	南方消费		
基金主代码	160127		
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)		
基金合同生效日	2012年3月13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	944,896,021.41份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012年4月25日		
下属分级基金的基金简称	南方消费基础	南方消费进取	南方消费收益
下属分级基金的场内简称	南方消费	消费进取	消费收益
下属分级基金的交易代码	160127	150050	150049
报告期末下属分级基金的份额总额	897,098,357.41份	23,898,832.00份	23,898,832.00份

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“南方消费”。

2.2 基金产品说明

投资目标	通过深入研究我国宏观经济结构转型方向和长期发展趋势,选择具备新兴消费增长主题的上市公司进行投资,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金运用定量分析和定性分析手段,从宏观政策、经济环境、证券市场走势等方面对市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,据此合理制定和调整资产配置比例。通过对股票、债券等各类资产进行配置,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合资产的稳定增值。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数×80%+上证国债指数×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,其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券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	010-66105798
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105799

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	14,866,606.90
本期利润	-124,424,308.59
加权平均基金份额本期利润	-0.1441
本期基金份额净值增长率	-12.47%
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	0.3847
期末基金资产净值	819,579,160.08
期末基金份额净值	0.867

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。

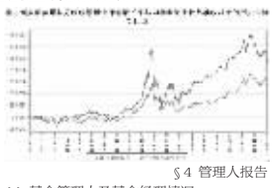
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-7.07%	1.60%	-5.12%	1.37%	-1.95%	0.23%
过去三个月	-7.47%	1.29%	-0.85%	1.25%	-6.62%	0.04%
过去六个月	-12.47%	1.36%	-3.79%	1.25%	-8.68%	0.11%
过去一年	0.54%	1.18%	11.13%	1.08%	-10.59%	0.10%
过去三年	17.59%	1.71%	15.28%	1.31%	2.31%	0.40%
自基金合同生效起至今	122.19%	1.64%	71.77%	1.22%	50.42%	0.42%

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
蒋秋洁	本基金基金经理	2014年12月18日	-	9	女,清华大学光电工程硕士,具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金,历任产品开发部研发员、研究部研究员、高级研究员,负责通信及传媒行业研究;2014年3月至2014年12月,任南方隆元基金经理助理;2014年6月至2014年12月,任南方中国梦基金经理助理;2014年12月至今,任南方消费基金经理;2015年6月至今,任南方天元基金经理;2015年7月至今,任南方隆元、南方消费活力的基金经理;2017年5月至今,任南方文旅混合基金经理。
李佳亮	本基金基金经理	2016年8月5日	-	5	美国南加州大学金融工程硕士,注册金融分析师(CFA),具有基金从业资格。2012年8月加入南方基金,任数量化投资部研究员;2015年5月至2016年8月,任量化投资经理助理;2016年8月至今,任南方消费基金经理;2016年11月至今,任南方中证500增强基金经理;2016年12月至今,任南方绝对收益基金经理;2017年4月至今, 任南方荣优基金经理;2017年11月至今,任大数据100、大数据300、南方量化成长基金经理。

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《南方新兴消费增长分级股票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

本报告期内,由于担心消费板块的白酒和家电经过2017年的上涨后,可能已透支未来增长空间。我们在基金持仓中增加了其他板块的配置。在风格上偏中性,在行业上也不做过度集中。在上半年股市的情绪性杀跌中,各个板块轮番下跌,都有较大的调整。分散配置在效果上短期内反而不如集中持股。净值相对基准有较大回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018年上半年,南方消费基金净值增长-12.47%,同期业绩比较基准增长-3.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,经济增长放缓风险犹存,但中国经济体量大,抗风险能力强,消费市场逐渐壮大成熟,将为经济增长提供新的增长引擎。虽然短期面临贸易战,金融系统去杠杆政策的不利影响,但长期来看,投资机会正慢慢显现。南方新兴消费的后续运作上,我们将继续维持相对中性的持仓配置。如果市场继续下跌,上涨较多的板块会面临较大回调压力, 而已经下跌较多的板块由于风险充分释放反而相对安全。均衡配置可以避免由于持仓过于集中而错配风险较高的板块。

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,在存续期内,本基金(包括南方消费基础份额、南方消费收益份额、南方消费进取份额)不进行收益分配。 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新兴消费增长分级股票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,南方新兴消费增长分级股票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新兴消费增长分级股票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。本报告期内,南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金未进行利润分配。

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股份管理有限公司编制和披露的南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金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:南方新兴消费增长分级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	6.4.7.1	114,674,841.71	105,487,856.33
结算备付金		13,510,166.56	14,833,154.01
存出保证金		11,838,095.45	17,042,527.17
交易性金融资产	6.4.7.2	671,153,934.06	693,670,476.69
其中:股票投资		671,153,934.06	692,759,176.69
基金投资		-	-
债券投资		-	911,300.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		14,935,279.39	-
应收利息	6.4.7.5	25,556.83	108,668.56
应收股利		-	-
应收申购款		1,774,199.25	2,257,565.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		827,912,073.25	833,400,247.76
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		5,049,477.20	5,110,731.25
应付管理人报酬		1,050,919.30	1,052,698.35
应付托管费		175,153.20	175,449.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,824,675.73	992,529.25
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	232,687.74	372,667.68
负债合计		8,332,913.17	7,704,076.25
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	368,609,326.85	325,117,088.05
未分配利润	6.4.7.10	450,969,833.23	500,579,083.46
所有者权益合计		819,579,160.08	825,696,171.51
负债和所有者权益总计		827,912,073.25	833,400,247.76

注: 报告截止日2018年6月30日,南方新兴消费基础份额净值0.867元,南方消费收益份额净值1.014元, 南方消费进取份额净值0.720元; 基金份额总额944,896,021.41份,其中南方新兴消费增长基础份额897,098,357.41份,南方消费收益份额23,898,832.00份,南方消费进取份额23,898,832.00份。

6.2 利润表

会计主体:南方新兴消费增长分级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		-110,220,079.16	82,390,589.23
1.利息收入		555,402.87	300,538.00
其中:存款利息收入	6.4.7.11	555,050.81	285,837.04
债券利息收入		352.06	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	14,700.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		27,928,910.97	7,285,310.69
其中:股票投资收益	6.4.7.12	24,666,217.85	3,122,725.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	165,042.96	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-4,481,945.14	-419,800.00
股利收益	6.4.7.16	7,579,595.30	4,582,385.59
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-139,290,915.49	74,442,364.79
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	586,522.49	362,375.75
减:二、费用		14,204,229.43	7,480,665.35
1、管理人报酬	6.4.10.2.1	6,649,843.92	3,586,711.03
2、托管费	6.4.10.2.2	1,108,307.27	597,785.17
3、销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4、交易费用	6.4.7.19	6,210,465.01	3,068,986.07
5、利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6、税金及附加		892.16	-
7、其他费用	6.4.7.20	234,721.07	227,183.08
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-124,424,308.59	74,909,923.88
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-124,424,308.59	74,909,923.88

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方新兴消费增长分级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)	325,117,088.05	500,579,083.46	825,696,171.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-124,424,308.59	-124,424,308.59
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)	43,492,238.80	74,815,058.36	118,307,297.16
其中:1.基金申购款	226,464,492.36	349,485,479.89	575,949,972.25
2.基金赎回款	-182,972,253.56	-274,670,421.53	-457,642,675.09
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)	368,609,326.85	450,969,833.23	819,579,160.08
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)	147,669,754.54	125,889,080.50	273,558,835.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	74,909,923.88	74,909,923.88
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)	122,702,233.52	126,669,531.63	249,371,765.15
其中:1.基金申购款	686,995,662.74	321,038,364.99	1,008,034,027.73
2.基金赎回款	-564,293,429.22	-194,368,833.36	-758,662,262.58
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)	270,371,988.06	327,468,536.01	597,840,524.07

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 关联方关系

6.4.1.1 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。

6.4.1.2 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	基金管理人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

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。

6.4.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.2.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.2.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
华泰证券	1,754,961,825.45	42.36	1,041,151,312.95	49.69

6.4.2.1.2 债券交易

注:无。

6.4.2.1.3 债券回购交易

注:无。

6.4.2.1.4 权证交易

注:无。

6.4.2.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
华泰证券	1,599,306.02	42.36	1,011,840.25	55.45
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
华泰证券	948,805.31	49.28	570,333.86	36.87

注: 1. 上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。 2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.2.2 关联方报酬

6.4.2.2.1 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	6,649,843.92	3,586,711.03
其中:支付销售机构的客户维护费	1,526,869.74	577,787.93

注: 支付基金管理人南方基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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 X1.50% / 当年天数。

6.4.2.2.2 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	1,108,307.27	597,785.17

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。

6.4.2.2.3 销售服务费

注:无。

6.4.2.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.2.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.2.4.1 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 南方消费基础	南方消费进取	南方消费收益
基金合同生效日(2012年3月13日)持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-
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	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 南方消费基础	南方消费进取	南方消费收益
基金合同生效日(2012年3月13日)持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	60,155,006.62	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	27,851,768.07	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	88,006,774.69	-	-
期末持有的基金份额	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

6.4.2.4.2 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。

6.4.2.5 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	114,674,841.71	399,675.56	75,916,091.11	190,234.47

注: 本基金由基金托管人中国工商银行保管的银行存款, 按银行约定利率计息。

6.4.2.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

6.4.2.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.3 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.3.1 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

6.4.12.1.1 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
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	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-

6.4.3.2 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
000426	兴业矿业	2018-06-18	重大事项	7.21	-	-	132,835	1,016,085.09	957,740.35	-
000603	盛达矿业	2018-06-11	拟筹划重大资产重组	10.83	2018-06-21	9.75	236,300	2,703,825.36	2,559,129.00	-
002408	齐翔腾达	2018-06-18	重大资产重组	12.28	-	-	84,600	1,179,537.31	1,038,888.00	-
002426	胜利精密	2018-06-18	拟披露重大事项	3.60	2018-07-03	3.26	268,900	1,117,032.40	968,040.00	-
300072	三聚环保	2018-06-18	拟披露重大事项	23.28	2018-07-10	24.00	73	2,324.57	1,699.44	-
300118	东方日升	2018-06-07	重大资产重组	9.45	2018-06-07	9.63	1,152,800	13,307,460.37	10,893,960.00	-
300146	汤臣倍健	2018-01-31	重大资产重组	16.60	2018-07-31	16.50	59,700	861,623.56	991,020.00	-
300197	铁汉生态	2018-05-28	重大资产重组	5.37	-	-	115,800	847,364.83	621,846.00	-
300324	旋极信息	2018-05-30	重大资产重组	9.49	-	-	452	4,797.00	4,289.48	-

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。

6.4.3.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.3.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

6.4.3.3.2 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	671,153,934.06	81.07
	其中:股票	671,153,934.06	81.07
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	-	-
	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	128,185,008.27	15.48
-	-	-	-
8	其他各项资产	28,573,130.92	3.45
9	合计	827,912,073.25	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	6,425,257.80	0.78
B	采矿业	12,389,441.65	1.51
C	制造业	496,858,718.09	60.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,125,325.91	0.50
E	建筑业	9,592,620.01	1.17
F	批发和零售业	51,839,724.98	6.33
G	交通运输、仓储和邮政业	1,103,964.68	0.13
H	住宿和餐饮业	16,051,728.00	1.96
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,919,394.64	1.21
J	金融业	4,154,418.88	0.51
K	房地产业	21,082,349.44	2.57
L	租赁和商务服务业	23,742,846.92	2.90
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,784,692.86	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	380.20	-
R	文化、体育和娱乐业	10,083,070.00	1.23
S	综合	-	-
	合计	671,153,934.06	81.89

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5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	000651	格力电器	808,339	38,113,183.85	4.65
2	600519	贵州茅台	50,076	36,628,590.96	4.47
3	000333	美的集团	616,450	32,191,019.00	3.93
4	000858	五粮液	357,594	27,177,144.00	3.32
5	600104	上汽集团	742,045	25,964,154.55	3.17
6	002304	洋河股份	168,700	22,200,920.00	2.71
7	600887	伊利股份	783,500	21,859,650.00	2.67
8	600511	国药股份	684,700	18,452,665.00	2.25
9	600741	华域汽车	740,235	17,558,374.20	2.14
10	600690	青岛海尔	864,268	16,645,801.68	2.03

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	600741	华域汽车	44,251,241.05	5.36
2	600887	伊利股份	39,943,537.99	4.84
3	002304	洋河股份	39,680,356.71	4.81
4	601933	永辉超市	39,221,067.90	4.75
5	600519	贵州茅台	38,790,015.88	4.70
6	600690	青岛海尔	38,252,358.02	4.63
7	002027	分众传媒	38,016,254.32	4.60
8	002024	苏宁易购	35,737,867.52	4.33
9	000895	双汇发展	35,653,767.57	4.32
10	000858	五粮液	35,008,350.51	4.24
11	300433	蓝思科技	31,071,370.77	3.76
12	600066	宇通客车	29,639,004.49	3.59
13	300055	万邦达	29,053,088.78	3.52
14	601997	贵阳银行	28,587,168.29	3.46
15	600438	通威股份	28,382,021.63	3.44
16	000069	华侨城A	28,339,549.32	3.43
17	300024	机器人	27,455,586.34	3.33
18	300199	翰宇药业	26,972,133.18	3.27
19	002311	海大集团	26,567,527.47	3.22
20	600104	上汽集团	26,341,509.01	3.19
21	600660	福耀玻璃	22,482,517.95	2.72
22	600827	百联股份	22,210,278.27	2.69
23	300136	信维通信	21,336,340.50	2.58
24	000568	泸州老窖	21,032,039.16	2.55
25	000651	格力电器	20,113,175.80	2.44
26	000596	古井贡酒	19,964,508.71	2.42
27	600511	国药股份	19,954,763.83	2.42
28	300244	迪安诊断