

南方荣定期开放混合型证券投资基金

2018年半年度报告摘要

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

送出日期：2018年08月27日

§ 1 重要提示

基金管理人、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。

基金经理人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年08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。

本报告中财务数据未经审计。

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

基金简称	南方荣定期开放混合
基金代码	003610
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月23日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	北京银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	161,462,350.41份
基金合同存续状态	不定期
下属分级基金的基金简称	南方荣定期开放混合A
南方荣定期开放混合C	南方荣定期开放混合C
下属分级基金的交易代码	003610
报告期末下属分级基金的份额总额	146,728,264.88份
报告期末下属分级基金的份额总额	5,734,095.53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“南方荣安”。

2.2 基金产品说明

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收益。
投资策略	本基金通过深入研究与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场的发展趋势，评估市场的系统性风险和各投资品种的预期收益与风险，据此合理配置股票、债券等资产的比例，以达到基金资产的保值增值。本基金将延续绝对估值法，力争投资组合的确定性。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：“90%沪深300指数收益率+10%×中债国债指数收益率”±6%。
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水平低于股票型基金，高于债券型基金，适合追求稳健收益的投资者。

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理有限公司	北京银行股份有限公司
信息披露义务人	席克川 联系电话：0755-82763888 电子邮件：managers@nfmfund.com.cn	刘峰 010-66223696
客户服务电话	400-889-8899	95526
传真	0755-82763889	010-66225309

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.nfmfund.com		

§ 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 利润数据和指标	报告期2018年01月01日至2018年06月30日	
本期已实现收益	-1,439,919.64	-68,354.46
本期平均基金份额利润	-1,084,776.33	-54,464.61
本期未分配利润	-0.0074	-0.0006
本期基金份额净值增长率	-0.69%	-0.90%
3.1.2 利润数据和指标	报告期2018年06月30日	
期末可供分配基金份额利润	0.0956	0.0906
期末基金资产净值	194,102,701.18	6,024,490.27
期末基金份额净值	1.0967	1.0906

注：1.本期实现收益指基金利息收入、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；

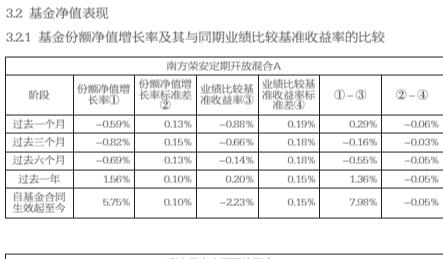
2.期末可供分配利润，采用期末资产价值中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不考虑当期发生数)。

3.所有基金业绩报酬不包括个人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列示。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

南方荣定期开放混合A



南方荣定期开放混合C



46 管理人对报告期内基金利润分配等情况的说明

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的基金合同有关约定的核算，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人已建立基金估值和份额净值的业务管理制度，明确基金估值的程序和方法；建立了估值委员会，组成人员包括副经理、监察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理等，本基金管理人使用的估值系统能识别各投资品种的估值特性和具体规则，且具备自动校正功能。

本基金管理人已按照法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照行业标准约定提供定价服务。基金经理人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。本报期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

47 管理人对报告期内基金利润分配等情况的说明

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日每份基金份额可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满90天不进行收益分配；

48 管理人对报告期内基金利润分配等情况的说明

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的基金合同有关约定的核算，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人已建立基金估值和份额净值的业务管理制度，明确基金估值的程序和方法；建立了估值委员会，组成人员包括副经理、监察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理等，本基金管理人使用的估值系统能识别各投资品种的估值特性和具体规则，且具备自动校正功能。

本基金管理人已按照法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照行业标准约定提供定价服务。基金经理人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。本报期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

49 管理人对报告期内基金利润分配等情况的说明

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日每份基金份额可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满90天不进行收益分配；

50 管理人对报告期内基金利润分配等情况的说明

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的基金合同有关约定的核算，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人已建立基金估值和份额净值的业务管理制度，明确基金估值的程序和方法；建立了估值委员会，组成人员包括副经理、监察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理等，本基金管理人使用的估值系统能识别各投资品种的估值特性和具体规则，且具备自动校正功能。

本基金管理人已按照法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照行业标准约定提供定价服务。基金经理人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。本报期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

51 报告期内本基金托管人遵守信守情况说明

在本报期内，本基金托管人在按照相关法律、法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，严格遵守了基金托管人应遵守的基

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

在本报期内，本基金托管人按照相关法律、法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，严格遵守了基金托管人应遵守的基

53 会计期间

54 会计期间

55 会计期间

56 会计期间

57 会计期间

58 会计期间

59 会计期间

60 会计期间

61 资产负债表

会计主体：南方荣定期开放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

62 利润表

63 会计期间

64 会计期间

65 会计期间

66 会计期间

67 会计期间

68 会计期间

69 会计期间

70 会计期间

71 会计期间

72 会计期间

73 会计期间

74 会计期间

75 会计期间

76 会计期间

77 会计期间

78 会计期间

79 会计期间

80 会计期间

81 会计期间

82 会计期间

83 会计期间

84 会计期间

85 会计期间

86 会计期间

87 会计期间

88 会计期间

89 会计期间

90 会计期间

91 会计期间

92 会计期间

93 会计期间

94 会计期间

95 会计期间

96 会计期间

97 会计期间

98 会计期间

99 会计期间

100 会计期间

101 会计期间

102 会计期间