南华瑞盈混合型发起式证券投资基金

基金管理人:南华基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

§1 重要提示及目录 1金管理人的董事会、董事保証本根也所裁查科不存在連假記載、妥与性施述成置大遗漏、并对其内容符 性、通確性現示器性実担付別及連帶的法律責任、本半年度报告已起ニ分之二以上報立董事を享利適 董事を安 基金行義分の連絡に対応と参加にある。 , 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24日复核了本报告中的财务 财运分配情况、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、误导的

me。 人,诉讼以诚实信用、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。 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 7-19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 本报告于明务资料未经时计。 本报告用[3]18年1月1日起至8日3小口 1-

§ 2 基金简介 2.1 基金基本情况

2.2 基金产品说明 资策略 2.3 基金管理人和

谢超 陆志俊 2.4 信息披露方 登载基金半年度报告 管理人互联网网址

3.1 主要会计数据和财务指标 全额单位, 人民市元

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)				
3.1.1 别则则致关系积时册标	南华瑞盈混合发起A	南华瑞盈混合发起C -536,381.9			
本期已实现收益	-3,354,801.24				
本期利润	-4,084,694.77	-653,288.24			
加权平均基金份额本期利润	-0.1816	-0.1811			
本期基金份额净值增长率	-19.05%	-19.32%			
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額利润	-0.2025	-0.2072			
期末基金资产净值	17,320,829.40	2,557,346.05			
期末基金份額净值	0.7975	0.7928			

主要财务指标和基金净值表现

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

2、上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.期末可性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; 4.本基金台同生效日为2017年08月16日。

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 率标准整2	业绩比较基准 收益率3)	业绩比较基准 收益率标准差 ④	10-3	2-4
过去一个 月	-9.35%	1.67%	-5.29%	0.90%	-4.06%	0.77%
过去三个 月	-16.07%	1.45%	-6.71%	0.79%	-9.36%	0.66%
过去六个 月	-19.06%	1.44%	-8.47%	0.81%	-10.58%	0.63%
自基金合同生效起 至今	-20.25%	1.14%	-3.27%	0.68%	-16.98%	0.46%

1.14% -3.27% 0.68% -17.45%

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



1. 本基金基金合同生效日为2017年8月16日, 截至本报告披露时, 本基金基金

各项资产配置比例符合基金合同的约定。 § 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

南华基金管理有限公司于2016年10月18日经中国证监会核准设立。于2016年 用字基並自建刊模公司)2010年10月;1615年16屆16至中國址面表彰在接处。)2010年 11月17日经工商注册登记成立、是国内第一家由明货次司金领货股份分募基金管 理公司。股东为南华明货股份有限公司。公司注册资本1.5亿元,注册地为浙江省东 阳市横店影响产业实验区市务楼。 截止报告期末,南华基金管理有限公司旗下共管理4只公募基金。分别为南华

瑞盈混合型发起式证券投资基金、南华瑞颐混合型证券投资基金、南华丰淳混合型 证券投资基金、南华瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、资产管理规模约10

姓名	职务	任本基金的! 理)	基金经理(助 期限	证券从业 年限	说明	
		任职日期	离任日期	24:105		
刘斐	本基金基金经理	2017-08-1 6	-	9年	部士研环党,用有基金从业资格。20 年至2009年,任期于开制设置的 网公司,担任研究员。2000年至20 年,任第1年版会有限胜任公司。 任研究员。2012年至2013年,任期于 分有限公司。担任研究员。2015年 2013年至2013年,任期十年 分有限公司。担任研究员。2015年 2017年,任期十年 司,担任研究员。2017年3月加入海 基金管营有限公司。即任师师金融之员。 同 (2017年12月由上的任务),由于 1020年12月11日,即任师师金融公司。 2017年12月11日代目,由于 2017年12月11日代目,由于 2017年12月11日代目,由于 2017年12月11日代目,由于 2012月11日代目,由于 2012月11日代目,由于 2012月11日代目,由于 2012月11日代目,由于 2012月11日代目,由于	
刘深	本基金基金经理	2017-10-2 6	-	9年	硕士研究生,具有基金从业资格。200 年至2011年任东海证券有限责任公 研究员,2011年至2016年任长城证 股份有限公司资深研究员,TMT行 组组长,对于成长股具各丰富的研究 验。2016年12月加入南华基金管理 限公司,现任南华瑞盈混合型发起式 办投资基金条矩果。	

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

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,中国监查会员生从"中虚党"。中于人民共和国进步及基金法。"寻有 关法律法规,中国监查会员,简单强温强器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,为基金份额持有人谋求最大利益。本程当即,基金资产,在严格控制风险的基础 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

4.31 公平交易制度的执行情况 4.31 公平交易制度的执行情况 报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度 捐导意见》和《商华基金管理有限公司公平交易管理规则》的规定,通过系统和人 工等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投资组

在投资决策内部控制方面,本基金管理人确保各投资组合在获取研究信息、投 帝建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度、明确各投资决策 以建议及实施这位张少司通子十一节的论案。建立该以该状态。对时时以及依然 主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资 信息的管理及保密制度,通过岗位投置、制度约束,技术手段相结合的方式,使不同 投资组合经理之间的持仓和交易等重大率分开投资信息相互腐杂 在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,交易部运用交易系统

中设置的公平交易功能并按照时间优先,价格优先的原则严格执行所有指令,确保 公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易,按照公平交易原则建立和完 **善了相关分配机制** 43.2 异常交易行为的专项说明 本基金管理人建立了对异常交易的控制及监控制度,报告期内未发现本基金

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. 程主人对依古别内基金的汉文采取时机坚纵转级的5699 4.4. 报告期内基金投资策略和运作分析 2018年上半年,中美贸易摩擦一波三折,趋势上持续恶化。国内经济在去杠杆 及金融监管等政策的累积效应影响下出现一定的下行压力。国内工业、投资、消费 参数据均出现一定程度的主势。在去年高基数及外需不确性增强的情况下,出口形 参不容天观。2季度GDP实标增速由1季度的6.8%下滑至6.7%。物价水平总体保持 稳定,PPI二季度出现反弹。 货币政策方面,央行通过连续降准及定向投放工具维持资金面整体宽松。3个

月Shibor由年初的4.73%下行至4.15%,1年国债收益率从3.90%下行至3.47%。股票市场风格频繁切换,在经济预期下滑及贸易摩擦升级等负面情绪带动下,市场风 险偏好急剧下行。 综合来看,上证综指下跌13.9%,深证综指下跌15.36%,中证转债指数下跌

综合来有,上址综相下跌15.9%,深址综相下跌15.36%,中址转阀指数下跌2.17%,中债综合全价指数上涨2.16%。 产品运作上,年初主要关注地产、金融板块。随后在风格上转向均衡配置,并重点挖掘中小市值股票中优质个股的投资机会。同时判断市场下跌更多是由于市场风险偏好急剧下降导致的,带行业龙头股票已具备较好的长期的投资价值。因此,将股票仓位维持在中性偏上水平,等待后期市场风险偏好修复带来的反弹行情。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现 截至报告期末南华瑞盈混合发起A基金份额净值为0.7975元,本报告期内,该 类基金份额净值增长率为-19.05%,同期业绩比较基准收益率为-8.47%;截至报告期末南华瑞盈混合发起C基金份额净值为0.7928元,本报告期内,该类基金份额

净值增长率为-19.32%,同期业绩比较基准收益率为-8.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 展望下半年,宏观经济面临的内外部形势依然复杂,中美贸易摩擦预计将长期 和复杂化,对国内经济增长的拖累尚未充分显现。国内实体经济在去杠杆和强监管 料复杂化,对国内经济增长的拖紧尚未充分显现。国内实体经济在去乱杆和强监管 政策的双重影响下,信用收缩明显,中小心血验资推和融资滑的问题更加几号。虽 然央行货而政策偏宽松,但流动性更多的还是体现在银行间市场,向实体企业的传 导不畅。7月份国务院常务会议及政治局会议强调把握好去杠杆力度,稳定国内经 茶,扩大内需,更好的财政政策作用,另外,资管新规即则及理财知则落地。预计下 半年宏观经济在政策利好的持续带动下会有所企稳,社融增速有所回升,整体风险

在政策维稳的情况下 预计资本市场风险偏好将有所恢复 尤其是股票市场经 让上华的分析则整合上,现订资本市场风险施财将有财政复。工具是股票市场空 过上半年的大幅则整后已具备较高的安全边际。但市场在未见到实体企业融资不 境和数据即显改善之前,出现趋势性上涨机会依然是小概率事件,我们判断市场整 体仍将维持震荡格局,但下跌空间相对有限。下半年在货币偏宽处的环境下,债券 收益率易下难上,宽货币逐新向宽信用过渡,信用利差有望进一步缩窄。 行业上看前期受信用风险影响较大的行业加全部业将迎来反转机会 周期的

行业如基理。建材、钢铁、架棚等具备企物保入11分1至30至膨延中2年从及49亿至,间2015 行业如基理。建材、钢铁、架棚等具备企物性机会。 基于以上分析,我们判断下半年A股市场将持续震荡,短期在政策转暖的边际 改善下市场程度单(但受制于国内外宏观经济环境。政策的施展空间有限,加之输 人型的通胀将推高企业生产成本,影响企业盈利改善空间,年内市场反弹空间受 限。对此我们将采取更加灵活的仓位控制手段,尽可能做出相对收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 报告报户《记号》5383年11848分,24776年3月786月 报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核 算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,对基金所持有的投资 品种进行信息、日常估值由基金管理人与基金托管人同进行,基金的额种值由基 金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年 亚自理人仍从回通月,在建立几百人及核无块日田基亚自理人为外公司。力术,中中和年末信值复核与基金公计账目的核对同时进行。会计师事务所在估值调整导致基金资产等值的变化在0.25%以上时对所采用的估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。47 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明报告期内本基金未实施利润分配。48 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工

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

5.1 报后别的"各继五七日八起來"目前仍如"明 本报告别的,基金托管人在《南华福盈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》及其他有实法律法规、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 托管人对报告别内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况

本报告期内,南华基金管理有限公司在南华瑞盈混合型发起式证券投资基金 · 社官司明內,南宁基金官理自與公司任南宁軍福征管官及亞式此對投資基金 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份额持有人利益的行为。 本报告期內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本报告期内,由南华基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关南华 瑞盈福合型及起式证券投资基金的半年度财务报告中财务指标、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)

(衣) |化强盈混合刑发起式证券投资其金 报告律

The Hit Minimute II Trixxx	TONTOLIN ON SHORE
截止日:2018年06月30日	
	单位
	, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		30 TO-1-00/ JOO H	100 TT -1-100 20 TH
银行存款	6.4.7.1	2,789,588.75	9,799,864.99
结算备付金		203,017.62	1,097,994.72
存出保证金		51,799.59	32,643.91
交易性金融资产	6.4.7.2	18,222,024.00	17,004,938.82
其中:股票投资	0.4.7.2.	18,222,024.00	17,004,938.82
基金投资		10,222,024.00	17,0074,100000
债券投资			
资产支持证券投资			
贵金属投资			
衍生金融资产	6.4.7.3		
买人返售金融资产	6.4.7.4		8,000,000.00
	034,734	-	0,000,000.00
应收证券前្ 应收利息	6.4.7.5	1,844.69	18,043.86
应收股利	0.4.7.0	1,044.09	10,043.80
应收申购款	+	-	10,250.00
<u> </u>	+ +	-	10,250.00
其他资产	6.4.7.6		
與他如:/** 资产总计	6.4.7.6	21,268,274.65	35,963,736.30
		太期末	
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06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		860,456.52	6,179,803.95
应付赎回款		8,458.31	19,580.00
应付管理人报酬		17,140.41	25,180.90
应付托管费		3,428.09	5,036.18
应付销售服务费		1,328.48	2,029.22
应付交易费用	6.4.7.7	420,403.05	224,785.57
应交税费		-	
应付利息		-	
应付利润		-	
逆延所得税负债		-	
其他负债	6.4.7.8	78,884.34	149,500.00
负债合计		1,390,099.20	6,605,915.82
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	24,945,204.36	29,808,663.33
未分配利润	6.4.7.10	-5,067,028.91	-450,842.85
所有者权益合计		19,878,175.45	29,357,820.48
负债和所有者权益总计		21,268,274.65	35,963,736.30

合发起C类基金份额净值0.7928元,基金份额总额3,225,815.76份

单位:人民币元

会计主体:南华瑞盈混合型发起式证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

期間	附注号	本期2018年01月01日至2018年06 月30日
一、收人		-4,106,319.63
1.利息收入		36,206.21
其中:存飲利息收入	6.4.7.11	32,619.89
债券利息收人		-
资产支持证券利息收入		-
买人返售金融资产收人		3,586.32
其他利息收人		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-3,304,997.46
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-3,381,276.82
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	-
股利收益	6.4.7.16	76,279.36
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	-846,799.86
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	9,271.48
减:二、费用		631,663.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	119,199.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	23,839.82
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	9,875.92
4. 交易費用	6.4.7.19	394,670.30
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	84,078.04
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-4,737,983.01
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-4,737,983.01

6.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:南华瑞盈混合型发起式证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

			单位:人民币
项目	2018	本期 年01月01日至2018年06	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)	29,808,663.33	-450,842.85	29,357,820.48
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数 (本期利 润)	-	-4,737,983.01	-4,737,983.01
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)	-4,863,458.97	121,796.96	-4,741,662.02
其中:1.基金申购款	180,068.24	-15,867.22	164,201.02
2.基金赎回款	-5,043,527.21	137,664.17	-4,905,863.04

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署

6.4.1 基金基本情况

温盈混合型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管 理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2017]906号《关于准予南华瑞盈粮合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由南华基金管理有限公司依照《中华 人民共和国证券投资基金法》和《南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金合 人民共和国业务投资益金法》和《南平墙盘商给空及起式业务投资基金金台同》负责公开筹集。本基金为契约显开场式,存续期限不定;首次设立募集不包括、以购资金利息共募集人民币281,176,171.65元,业经普华未遗中天会计师事务所符殊普通合伙营华永遗中天台计师事务所将殊普通合伙营华永遗中天验学(2017)第804号验资报告予以验证。经向中国证证金含案《南华珠遗和各型发起式证券投资基金基金合同》于2017年8月16日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为281,234,505.55份基金份额,其中认 购资金利息折合58,333,90份基金份额。本基金的基金管理人为南华基金管理有限 公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。 本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金

◆基金稅類以购/甲购效用、與回效用、明当服分效用收取刀、以7小四、內在並 份額分为不同的类別。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,赎回时收取赎回 费用,且不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资者 认购/申购时不收取认购/申购费用,赎回时收取赎回费用,且从本类别基金资产中 计提销售服务费的,称为C类基金份额。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额 和C类基金份额分别计算基金份额净值。本基金不同基金份额类别之间不得互相

程撰《中华人民共和国证券投资基金法》和《南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准 上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、 短期融资券,超短期融资券,次级债券,政府支持机构债券,政府支持债券,地方政 是对确定以不。但是的确定以不从处理的。 所债券、可转换债券、同交换债券、分离交易可转债及其他经中国证金允许投资 的债券、债券回购。资产支持证券、股指即货、国债期货、投资、货币市场工具、同业 存单、银行市款以及现金、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工 具。本基金的投资组合比例为;股票资产占基金资产的比例范围为60%—95%。每个 交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基 金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券 本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×70%+中债综合全价(总值)指

本基金的业级CX基准为行数收益率×30%。 6.4.2 会计报表的编制基础 本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会

计准则 – 基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、 中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度 计算加重数例的"现代及设施工程"的表现的"中国基金业协会"以下简称"中国基金业协会"以下简称"中国基金业协会"以下简称"中国基金业协会"以下简称"中国基金业协会"以中国证监会,中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告

期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。 6.4.4 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

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明 本基金本报告期无需要说明的会计估计变更 6.4.5.3 差错更正的说明 本基金本报告期无需要说明的差错更正变更。

本基金本推告則先需要说明的差错更正变更。 6.4.6 税项 根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通 划》,财税[2003]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 [2015]101号《大于上市区中成总社·科廷加任广人对特别政策有等代询船的通知》,财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营业税就点金融业有关政策的通知》,财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开等改增就点金融业有关政策的通知》,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《关于资管产品增值移

官产品可能处现来有头问题的外外达到31,则约6207户进度的操作,大于该官产品可能税 有关问题的通知),财税207190号(关于租人周定资产进项税额抵扣等增值税政 策的通到)及其他相关财税法规和设务操作,主要税项列示如下: (1)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,每适用简易 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 经营产品经过度经济。

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 (2)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

(2)对基金从此学中动叶取传护收入,包括5类系股票、饭好的差价收入,成架的 股息 红和收入,债券给约高度收入及其他收入,暂不证收企业所得税。 (3) 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 在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计人应纳税所得额,持股期限超过1年的,营减按50%计入应纳税所得额,持股期限超过1年的,营减按50%计入应纳税所得额,持股期限超过1年的,营减按0%计入应纳税所得额,持股期限超过1年的、营减按0%计入应纳税所得额,持股期限超过1年的。 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

(4)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 (4)為並至此的人 易印花税。 (5)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

6.4.7.1 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

本报告期内存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方 6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

元。 6.4.8.1.2 权证交易 6.4.8.1.3 债券交易

6.4.8.1.4 债券回购交易 6.4.8.1.5应支付关联方的佣金 6.4.8.2 关联方报酬 6.4.8.2.1 基金管理费

日管理人报酬=前一日基金 6.4.8.2.2 基金托管费	至每月月底,较月又时。其间异公五/列: 资产净值×1.0% ÷ 当年天数。
	单位:人民币元
项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	23,839.82
注: 支付基金托管人中国银行	 于股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值

支付基金管理人南华基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资

0.2%的年费率计据,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×0.2% + 当年天数。 6.4.8.2.3 销售服务费

		单位:
2018年01月	本期 月01日至2018年06月30日	
当期发生的	>基金应支付的销售服务费	
南华瑞盈混合发起A	南华瑞盈混合发起C	合计
-	7,003.00	7,003.00
-	1,205.13	1,205.13
-	1,409.99	1,409.99
-	9,618.12	9,618.12
	海翔发生的 南华藩齑混合发起A	2010年01月01日第2018年00月30日 前期改生的基金收支付的前組務費 南年職務部合效配A 南年職務部合效配C - 7,000.00 - 1,206.13 - 1,400.99

在:文门 建亚明三中间时间的同时间次 对10公交建立 (1) 《阿里亚 以一年 [1] 《西亚 以一 以一年 [1] 《西亚 以一 以一 以一 《西亚 以一 以一 《西亚 以一 以一 《西亚 以一 《西西 以一 《西西 以一 年天数

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

64.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 南华瑞盈混合发起A

		加州中山
项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	
基金合同生效日(2017年08月 16日)持有的基金份额	10,003,950.00	
报告期初持有的基金份额	10,003,950.00	
报告期间申购/买人总份额	-	
报告期间因拆分变动份额	-	
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	
报告期末持有的基金份额	10,003,950.00	
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	46,06%	
南华瑞盈混合发起C		
		份额单位

- . .于2017年8月16日 (基金合同生效日) 至2018年6月30日止期间,基金管理 人南华基金认购本基金的交易委托南华基金直销中心办理,适用费率为1,000.00 2. 基金份额占比以该类别基金总份额为分母计算

6.4.8.4.2 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

6485 中关联方保管的银行存款全额及当期产生的利息收入 单位:人民币元

注, 本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管, 按约定利率

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

元。 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

《7 投资组合报告 7.1 期末基金资产组合情况

			金额单位:人戶
序号	項目	金額	占基金总资产的比例(%
1	权益投资	18,222,024.00	85.68
	其中:股票	18,222,024.00	
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	买人返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买人返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,992,606.37	
8	其他各项资产	53,644.28	
9	合计	21,268,274.65	100.0
7.2. 扌	设告期末按行业分类的股票投资		
7.2.1	报告期末按行业分类的境内胜	2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(%
Α	农、林、牧、渔业	-	-
В	328°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

文化、体育和娱乐

2018年半年度报告摘要

占基金资产净值 比例(%)	公允价值(元)	数量(股)	股票名称	股票代码	序号
4.97	988,000.00	13,000	五粮液	000858	1
4.86	966,644.00	16,100	中际旭创	300308	2
4.30	854,550.00	9,000	药明康德	603259	3
4.27	848,700.00	18,000	格力电器	000651	4
4.01	797,850.00	15,000	大族激光	002008	Б
3.98	791,180.00	13,000	泸州老客	000568	6
3.84	764,100.00	18,000	绝味食品	603517	7
3.76	747,040.00	16,100	浙江県力	603338	8
3.69	733,600.00	20,000	乐普医疗	300003	9
3.17	629,400.00	30,000	蓝思科技	300433	10

号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值 比例(%)	
	600029	南方航空	4.943.360.00	16.84	
	601111	中国国航	3,247,581.00	11.06	
	002456	欧菲科技	2,974,545.00	10.13	
_	601939	建设银行	2,842,778.00	9.68	
_	600115	东方航空	2,685,763.00	9.15	
_	600048	保利地产	2,407,090.00	8.20	
_	002371	北方华创	2,399,100.00	8.17	
_	601398	工商银行	2,264,240.00	7.71	
_	002008	大族激光	2,262,750.00	7.71	
)	002368	太极股份	2,064,712.00	7.03	
	600031	三一面工	2,047,802.00	6.98	
_	600438	通威股份	1,874,809.00	6.39	
3	603799	华友铁业	1,862,857.00	6.35	
1	601336	新华保险	1,838,334.00	6.26	
_	601155	新城枠股	1,824,544.00	6.21	
3	601318	中国平安	1,823,945.00	6.21	
,	300036	超图软件	1,705,898.00	5.81	
3	000858	五粮液	1,694,533.00	5.77	
)	600340	华夏幸福	1,670,014.00	5.69	
)	002475	立	1,666,559.00	5.68	
	600036	招商银行	1,623,037.00	5.53	
_	002415	海廊城裡	1,549,356.00	5.28	
	300618	寒锐钻业	1,540,316.00	5.25	
_	000568	泸州老客	1,526,665.00	5.20	
_	300136	信維通信	1,513,776.00	5.16	
	600383	金地集团	1,452,162.00	4.95	
,	300433	苗思科技	1,417,037.00	483	
	601288	农业银行	1,407,640.00	4.79	
_	300308	中际旭创	1,389,921.00	4.73	
,	002343	慈文传媒	1,298,47271	4.73	
_	000938	紫光股份	1,268,517.00	432	
_	300296	利亚德	1,254,136.00	4.32	
_	000717	韶钢松山	1,252,740.00	4.27	
-	601100	恒立液压	1,232,740.00	4.24	
_	601899	紫金矿业	1,241,920.00	4.23	
_	300347	泰格医药	1,230,832.00	4.19	
_	300015	爱尔眼科	1,222,068.97	4.16	
_	300661	圣邦股份	1,199,219.00	4.00	
,	000002	五种版切 万科A	1,199,219.00	4.08	
,	000002	格力电器	1,195,353.00	4.00	
_	603605	伯万电奇 珀萊雅	1,189,573.00	4.07	
	600038	中直股份	1,181,480.00	4.02	
_	601601	中国太保	1,162,409.00	3.96	
_	600276	行瑞灰药	1,124,484.00	3.83	
_	600703	三安光电	1,124,484.00	3.78	
_	601088	二女元电 中国袖佐	1,093,478.00	3.78	
_	600167	联美控股	1,083,478.00	3.72	
_	603111	康尼机 电	1,079,738.00	3.60	
_	603259	药明康德	1,055,447.00	3.60	
_	603259	約明康德 浙江麻力	1,041,635.00	3.56	
_	603043	广州酒家	1,028,337.05	3.50	
_		_			
_	600570	恒生电子	1,001,546.00	3.41	
_	603517	绝味食品	986,055.00		
_		贵州茅台	934,968.00	3.18	
_	002389	南洋科技	914,885.00	3.12	
_	000333 600887	美的集团	910,485.00	3.10	
_		伊利股份	896,169.00	3.05	
_	002019	101111111111111111111111111111111111111	891,414.80	3.04	
	600584	长电科技	881,098.00	3.00	

1,362,3

7.4.3 头人股票的成本总额及买	单位:人民司
买人股票成本(成交)总额	153,249,141.15
卖出股票收入(成交)总额	147,803,979.29

7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投

本基金本报告期末未持有资产支持证券。 7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属投资。 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。 7.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货投资,也无期间损益。

7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。 7.10投资组合报告附注

7.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调 查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴

责、处罚。 7.10.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之 外的股票。

7.10.3 期末其他各项资产构成

		单位:人民
序号	名称	金額
1	存出保证金	51,799.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,844.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。 7.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

《8 基金份额持有人信息 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

18,12

份额单位:份 与总份省 比例 11,715,43 3,225,81

2 期本基金官理人的从	业人贝衍有本档	医亚门门门	
项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额
金管理人所有从业人员持有本基	南华瑞盈混合发起 A	62,340.77	

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
	南华瑞盈混合发起A	0-10
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南华瑞盈混合发起C	10-50
	合计	10-50
	南华瑞盈混合发起A	O-10
本基金基金经理持有本开放式基金	南华瑞盈混合发起C	0-10
	Alt	0.10

8.4发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份額占 基金总份額 比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,003,950.00	40.10%	10,003,950.00	40.10%	ne 3年
基金管理人高级管理人员	152,118.38	0.61%	-	-	-
基金经理等人员	51,005.88	0.20%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
☆ H	10. 207. 074.26	40.92%	10.003.950.00	40.10%	_

§ 9 开放式基金份额变动

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额,基金总赎回份额含转换出份 § 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 本报告期内基金管理人的重大人事变动情况: 经南化其全管理有限公司第一届董事全第十次会议审议通过 并按规定向由 国证券投资基金业协会报备,基金管理人于201 更公告,自2018年5月17日起,武祎先生不再担任本基金管理人督察长,并由总经 理路秀妍女士代任督察长职务

经南华基金管理有限公司第一届董事会第十一次会议审议通过,并按规定向 中国证券投资基金业协会报备,基金管理人于2018年6月21日发布高级管理人员 任职公告,自2018年6月20日起,陈琨先生担任公司副总经理。

(2)本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 本报告期内无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变 本基金本报告期内投资策略未发生改变。

本报告期内为本基金提供审计服务的会计师事务未发生变更,仍为普华永道 中天会计师事务所(特殊普通会伙)

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 本报告期内,本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员

无受稽查或处罚等情况。 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

占当期股 票成交总 额的比例 与当期佣 金总量的 比例

1、交易单元的选择标准 (1)证券经营机构经营业务全面,资力雄厚,信誉良好且财务状况良好; (2)经营行为规范,内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,建立相关业务

利益冲突防范机制,完善隔离墙制度,确保研究、投行服务客观公正,并能满足基金 资金投资运作高度保密的要求: (3)研究实力强,有独立的研究部门和50人以上的研究团队,能提供宏观经济

报告、行业报告、市场走向分析、推荐模拟组合、债券分析报告、个股分析报告及其 他专门报告。 2、证券交易单元选择程序

由基金管理人研究部发起立项申请,并联合相关部门根据评分标准对拟选择 证券经营机构从不同角度进行评估、打分;研究部汇总评分结果,呈报公司领导审

批后,基金管理人与选定证券经营机构签订证券交易单元租用协议。 § 11 影响投资者决策的其他重要信息 1.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	序号	持金的 持金的 持金的 持	期初份額	申购份额	赎回份额	持有份額	份额占比
机构	1	2018.01. 01-201 8.06.30	10,003,950.00	0.00	0.00	10,003, 950.00	40.1%
				产品特有风	UND		
基金扣	管理	人表承谨慎	勤勉、独立决策、规 额比例达到或超过			资者,保障投资者 專句紙,	合法权益。当年

相有权大店语权; (5)极端情况下,持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后,可能出现连续六十个工作日基金资产着 直低于5000万元而面临的转换基金运作方式,与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息