

南华瑞盈混合型发起式证券投资基金

2019年第三季度报告

本期报告期内流动性是否充裕等事件出现较大分歧,导致入股价出现较大波动,上述信息在2800-3200点之间震荡,板块之间也出现了明显的分化,高盈利能力、高分红的核心资产受到市场追捧,而周期类、科技类公司有较大跌幅。

二季度,在股债双杀背景下,中国权益资产判断不断变化的背景下,本基金继续维持较为集中的仓位水平,同时投资的偏好继续向未来能够继续发挥长期稳定增长的优质资产集中,重点配置能够享受α收益、通过降低标的之间的相关性来分散风险,努力实现在中长期内实现超越业绩比较基准,这一策略取得了较好的成效,截至2019年6月30日,南华瑞盈混合发起A基金份额净值为0.7096元,年内净值增幅为27.11%。

截至报告期末南华瑞盈混合发起A基金份额净值为0.7096元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为5.36%,同期业绩比较基准收益率为-0.76%;截至报告期末南华瑞盈混合发起C基金份额净值为0.7015元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为5.24%,同期业绩比较基准收益率为-0.76%。4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注:本基金建仓期为2017年8月16日至2018年2月15日,截至本报告期末,本基金建仓期已满。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Position, Tenure, and Description. Lists fund managers like 周景旋 and 莫志刚.

注:(1)基金经理周景旋的任职日期是指本基金基金合同生效之日;(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,中期证监会和《南华瑞盈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,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,本基金运作合规,没有出现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、法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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指导意见》和《证券投资基金管理公司公平交易管理制度》的规定,通过系统和技术手段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各投资组合。

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、投资决策及实施投资计划等方面享有平等的权利。健全投资决策授权制度,明确各投资主体的职责和授权范围,投资组合经理在授权范围内自主决策,建立投资信息隔离墙,确保各投资组合之间以及投资组合与关联方之间不存在利益输送和利益冲突。

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通过对优先、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,对一级市场申购等非市场化交易,按照公平交易原则建立申报和等待机制。

4.3.2 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监控及监控制度,报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.2.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年三季度,在经济缓慢复苏的背景下,市场对未来经济是否见底、贸易战谈

Table with columns: No., Code, Name, Shares, Net Value, and Ratio. Lists top 10 securities held by the fund.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

5.5 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债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

5.6 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资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.7 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明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未受监管部门立案调查,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公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金本报告期内不存在投资超出基金合同规定的备选股票库之外的股票的情形。

5.11.3 其他资产构成

Table with columns: No., Name, and Amount. Lists other assets like cash and derivatives.

报告期末前十大基金份额总额 18,231,140.57 2,948,637.88

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 19,138.20 4,643.731

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 568,513.42 1,063,989.83

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 568,513.42 1,063,989.83

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 17,700,700.34 1,027,289.74

注:总申购份额含转换转入份额;总额申购份额含转换转入份额。

南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金

2019年第三季度报告

本期报告期内流动性是否充裕等事件出现较大分歧,导致入股价出现较大波动,上述信息在2800-3200点之间震荡,板块之间也出现了明显的分化,高盈利能力、高分红的核心资产受到市场追捧,而周期类、科技类公司有较大跌幅。

二季度,在股债双杀背景下,中国权益资产判断不断变化的背景下,本基金继续维持较为集中的仓位水平,同时投资的偏好继续向未来能够继续发挥长期稳定增长的优质资产集中,重点配置能够享受α收益、通过降低标的之间的相关性来分散风险,努力实现在中长期内实现超越业绩比较基准,这一策略取得了较好的成效,截至2019年6月30日,南华中证杭州湾区ETF基金份额净值为1.1342元,本报告期内,基金份额净值增长率为-4.35%,同期业绩比较基准收益率为-5.72%。4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注:本基金建仓期为2017年12月14日至2018年6月13日,截至本报告期末,本基金建仓期已满。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Position, Tenure, and Description. Lists fund managers like 周景旋 and 莫志刚.

注:(1)基金经理周景旋的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理莫志刚的任职日期是指本公司中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效之日;(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,中期证监会和《南华中证杭州湾区交易型开放式指数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,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,本基金运作合规,没有出现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、法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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指导意见》和《证券投资基金管理公司公平交易管理制度》的规定,通过系统和技术手段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各投资组合。

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、投资决策及实施投资计划等方面享有平等的权利。健全投资决策授权制度,明确各投资主体的职责和授权范围,投资组合经理在授权范围内自主决策,建立投资信息隔离墙,确保各投资组合之间以及投资组合与关联方之间不存在利益输送和利益冲突。

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通过对优先、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,对一级市场申购等非市场化交易,按照公平交易原则建立申报和等待机制。

4.3.2 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监控及监控制度,报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.2.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度初期,市场延续此前涨势趋缓中,但随着北向资金连续两月净流入出现企稳,中美贸易摩擦的反复,市场也经历了一波快速调整。本基金作为被动投资的产品,其目标是通过跟踪、复制中证杭州湾区指数,为投资者获取该市场的平均收益。在投资策略上,本基金采用完全复制策略跟踪指数,并且利用量化方法进行精细化管理,控制跟踪偏离度。

报告期内,本基金跟踪误差主要来源于:(1)成分股分红;(2)成分股停牌;(3)成分股涨跌停。本基金通过现金替代、停牌个股估值调整、成份股停牌期间的估值调整、力求跟踪误差最小化。

4.5 报告期内基金业绩表现

截至报告期末南华中证杭州湾区ETF基金份额净值为1.1342元,本报告期内,基金份额净值增长率为-4.35%,同期业绩比较基准收益率为-5.72%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: No., Item, Amount, and Ratio. Lists portfolio composition.

注:投资组合中不包含可退转债转股投资

5.2 报告期末(指数投资)行业分类的境内股票投资组合

Table with columns: No., Industry, Amount, and Ratio. Lists industry allocation.

注:本基金本报告期末未持有港股通股票

5.3 报告期末(指数投资)行业分类的境外股票投资组合

Table with columns: No., Industry, Amount, and Ratio. Lists foreign stock allocation.

注:本基金本报告期末未持有境外股票

5.4 报告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

Table with columns: No., Name, Shares, Net Value, and Ratio. Lists top 10 stocks.

5.5 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债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

5.6 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资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.7 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明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未受监管部门立案调查,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公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金本报告期内不存在投资超出基金合同规定的备选股票库之外的股票的情形。

5.11.3 其他资产构成

Table with columns: No., Name, and Amount. Lists other assets.

报告期末前十大基金份额总额 18,231,140.57 2,948,637.88

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 19,138.20 4,643.731

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 568,513.42 1,063,989.83

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 568,513.42 1,063,989.83

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 17,700,700.34 1,027,289.74

注:总申购份额含转换转入份额;总额申购份额含转换转入份额。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票

5.3 报告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

Table with columns: No., Name, Shares, Net Value, and Ratio. Lists top 10 stocks.

5.4 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债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

5.5 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资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.6 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明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

5.7 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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未受监管部门立案调查,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公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金本报告期内不存在投资超出基金合同规定的备选股票库之外的股票的情形。

5.11.3 其他资产构成

Table with columns: No., Name, and Amount. Lists other assets.

报告期末前十大基金份额总额 18,231,140.57 2,948,637.88

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 19,138.20 4,643.731

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 568,513.42 1,063,989.83

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 568,513.42 1,063,989.83

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 17,700,700.34 1,027,289.74

注:总申购份额含转换转入份额;总额申购份额含转换转入份额。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票

5.3 报告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

Table with columns: No., Name, Shares, Net Value, and Ratio. Lists top 10 stocks.

5.4 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债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

5.5 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资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.6 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明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

5.7 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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未受监管部门立案调查,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公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金本报告期内不存在投资超出基金合同规定的备选股票库之外的股票的情形。

5.11.3 其他资产构成

Table with columns: No., Name, and Amount. Lists other assets.

报告期末前十大基金份额总额 18,231,140.57 2,948,637.88

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 19,138.20 4,643.731

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 568,513.42 1,063,989.83

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 568,513.42 1,063,989.83

报告期末前十大基金份额持有人持有基金份额总额 17,700,700.34 1,027,289.74

注:总申购份额含转换转入份额;总额申购份额含转换转入份额。

南华基金管理人: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

报告送出日期:2019年07月16日

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。

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2019年7月12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,也不保证基金份额持有人资产不受损失。

基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者有风险,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2019年7月16日起生效。

基金产品概况

Table with columns: Name, Type, and Description. Lists fund details like 南华瑞盈混合发起.

主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

Table with columns: No., Indicator, and Value. Lists financial metrics like 1.本期投资收益.

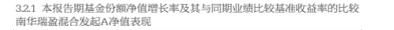
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

基金净值表现

3.2.1 本报告期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

Table with columns: Period, Net Value Growth, Benchmark Growth, and Difference. Compares fund performance to benchmark.

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:(1)本基金合同生效以来以基金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

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

报告送出日期:2019年07月16日

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。

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2019年7月12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,也不保证基金份额持有人资产不受损失。

基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者有风险,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2019年4月1日起生效。

基金产品概况

Table with columns: Name, Type, and Description. Lists fund details like 南华中证杭州湾区ETF.

主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

Table with columns: No., Indicator, and Value. Lists financial metrics like 1.本期投资收益.

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)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。

基金净值表现

3.2.1 本报告期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

Table with columns: Period, Net Value Growth, Benchmark Growth, and Difference. Compares fund performance to benchmark.

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:(1)本基金合同生效以来以基金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

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

报告送出日期:2019年07月16日

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。

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2019年7月12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,也不保证基金份额持有人资产不受损失。

基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者有风险,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2019年4月1日起生效。

基金产品概况

Table with columns: Name, Type, and Description. Lists fund details like 南华中证杭州湾区ETF.

主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元