

基金管理人：南方基金管理股份有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2019年7月16日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会对本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同的约定，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基金的招募说明书。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 南方军工混合

基金代码 004224

交易方式 契约型开放式

基金合同生效日 2017年3月10日

报告期末基金份额总额 763,426,161.96份

投资目标 在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，通过专业研究分析，精选具有核心竞争力的国十大军工集团优质标的，包括主机厂、子系统、核心零部件配套企业。对于民参军企业自下而上优选标的，精选具有技术积累、研发能力和效率优势的成长股。

4.5 报告期内本基金的业绩评价说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

南方军工改革灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告



好具有核心竞争力的国十大军工集团优质标的，包括主机厂、子系统、核心零部件配套企业。对于民参军企业自下而上优选标的，精选具有技术积累、研发能力和效率优势的成长股。

4.5 报告期内本基金的业绩评价说明

截至报告期末，本基金份额净值为0.6945元，报告期内，份额净值增长率为-7.54%，同期业绩基准增长率为-7.65%。

4.6 报告期内本基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	499,039,594.53	91.27
其中：股票		499,039,594.53	91.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,009,000.00	5.62
其中：债券	30,009,000.00	5.62	
货币市场基金	-	-	
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	15,406,417.08	2.89
8	其他资产	1,181,401.67	0.22
9	合计	533,536,413.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-	-
B 采矿业	321,498.05	0.06	
C 制造业	444,567,123.57	83.94	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-	
E 建筑业	5,160,472.00	0.97	
F 批发和零售业	-	-	
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-	
H 餐饮和住宿业	-	-	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	34,776,489.77	6.56	
J 金融业	33,869.94	0.01	
K 房地产业	-	-	
L 租赁和商务服务业	-	-	
M 科学研究、技术服务和地质勘查业	-	-	
N 水利、环境和公共设施管理业	2,067,034.00	0.39	
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	23,106.60	0.00	
S 综合	-	-	
合计	499,039,594.53	91.84	

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.2.1 报告期末持有港股通投资股票

本基金报告期末未持有港股通投资股票。

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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	6,728,100	37.69%
2	地方政府债	1,782,900	28.09%
3	中期票据	926,000	27.14%
4	短期融资券	1,160,000	26.34%
5	中小企业私募债	745,466	24.94%
6	中期票据	911,853	21.58%
7	可转换债券	2,114,500	20.72%
8	同业存单	805,023	18.17%
9	货币基金	2,941,200	18.17%
10	中长期债券	426,500	3.60%

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明

细

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十名资产支持证券

投资明细

本基金报告期末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

本基金报告期末未持有贵金属。

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

本基金报告期末未持有权证。

5.9 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资产支持证券

投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.10 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

本基金报告期末未持有股票。

5.11 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债券投资

明

本基金报告期末未持有债券。

5.12 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权证投资

明

本基金报告期末未持有权证。

5.13 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	156,660.80
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股息	441,230.49
5	应收申购款	583,514.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,181,401.57

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.16 开放式基金份额变动

单位：份

序号	报告期初基金份额总额	报告期末基金总份额
1	729,363,094.26	296,111,597.98
2	262,020,099.38	-
3	763,436,581.96	-

5.17 基金管理人运用固有资金投资的前十名证券

本基金报告期末未持有固有资金。

5.18 基金管理人运用固有资金投资的前十名贵金属

本基金报告期末未持有贵金属。

5.19 基金管理人运用固有资金投资的前十名权证

本基金报告期末未持有权证。

5.20 基金管理人运用固有资金投资的前十名权证投资

本基金报告期末未持有权证。

5.21 基金管理人运用固有资金投资的前十名股票

本基金报告期末未持有股票。

5.22 基金管理人运用固有资金投资的前十名股票投资

本基金报告期末未持有港股投资股票。

5.23 基金管理人运用固有资金投资的前十名股票

本基金报告期末未持有股票。

5.24 基金管理人运用固有资金投资的前十名股票

本基金报告期末未持有股票。

5.25 基金管理人运用固有资金投资的前十名股票

本基金报告期末未持有股票。

5.26 基金管理人运用固有资金投资的前十名股票