

南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人：南方基金
基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期：2019年8月23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法律责任。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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月21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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

2 基金基本情况

基金名称	南方畅利定期开放债券发起
基金代码	000903
基金运作方式	开放式
基金合同生效日	2018年12月19日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,997,019,068.94份
基金合同存续期	不定期

注：本基金在交易所行情系统净值申购等其他信息披露场合下，可简称为“南方畅利”。

3 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率。
投资策略	本基金管理人将综合运用多种策略，以追求基金资产的长期增值为目标。在资产配置上，本基金管理人将采取自上而下的策略，根据宏观经济、政策、市场利率、信用状况等因素，动态调整基金资产在固定收益类资产、权益类资产、现金类资产之间的配置比例，并在此基础上进行个股选择。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

4 基金管理人及基金托管人

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 上海浦东发展银行股份有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名：周涛 联系电话：0755-62778888 电子邮箱：managew@nfm.com.cn 传真：0755-62788889	姓名：孙洪斌 联系电话：021-61618888 电子邮箱：shb@pudong.com.cn 传真：021-62788889

5 信息披露方式

本基金半年度报告正文的管理人及托管人网址：<http://www.nffund.com>
基金半年度报告备查地点：基金管理人、基金托管人办公场所

6 主要财务指标和基金净值表现

3.1.1 期间数据和指标	报告期末2019年1月1日至2019年6月30日
本期累计实现收益	23,032,028.92
本期利润	24,752,987.08
期间平均基金份额本期利润	0.0196
本基金基金份额净值增长率	1.79%
3.1.2 期末基金份额净值	1.0191
期末可供分配基金份额净值	0.0191
期末基金份额净值	2,038,127,328.24
期末基金份额总额	1,019,101

7 基金业绩比较基准

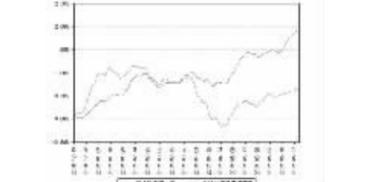
注：1. 基金业绩指标不包括持有认(申)购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平低于所列数字；
2. 本期已实现收益收益为基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
3. 本期可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中实现部分的孰低数。

8 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

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	③-④
过去一个月	0.50%	0.53%	0.28%	0.22%
过去三个月	0.90%	0.94%	-0.24%	1.14%
过去六个月	1.79%	0.94%	0.24%	1.56%
自基金合同生效起至今	19.1%	0.94%	0.6%	12.6%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩跟踪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：本基金成立于2018年12月19日生效，截至本报告期末基金成立未满一年，自基金成立日起6个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

9 基金管理人

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7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。2019年7月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为36172万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司41.16%、深圳市投资控股有限公司27.44%、厦门国际信托有限公司13.72%、兴业证券股份有限公司9.15%、厦门合泽企业管理合伙企业(有限合伙)2.10%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)2.12%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)2.20%。目前，公司在上海、合肥、成都、深圳、南京等地设有分公司，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准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)管理资产规模超过3800亿元，旗下管理191只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职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)及基金业绩助理简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业资格	说明
张海波	本基金基金经理	2018年12月19日至今	是	女，中国人民大学金融学硕士，具有基金从业资格。曾任前融通资产管理公司基金经理，2017年10月至2018年11月，任南方基金基金经理。2018年12月19日起，任南方基金基金经理。2018年4月至2018年7月23日，任南方基金基金经理。2018年7月23日至2018年10月31日，任南方基金基金经理。2018年10月31日至2019年1月1日，任南方基金基金经理。2019年1月1日至2019年6月30日，任南方基金基金经理。
周涛	本基金基金经理	2018年12月19日至今	是	男，清华大学工学学士，新加坡管理大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾任南方基金管理股份有限公司基金经理，2017年10月至2018年11月，任南方基金基金经理。2018年12月19日起，任南方基金基金经理。2018年4月至2018年7月23日，任南方基金基金经理。2018年7月23日至2018年10月31日，任南方基金基金经理。2018年10月31日至2019年1月1日，任南方基金基金经理。2019年1月1日至2019年6月30日，任南方基金基金经理。

注：1. 本基金前任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期；
2. 证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵守信情况的说明

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、中国证监会和本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，基金运作整体符合合同约定，没有出现有损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业务各环节严格控制系统公平执行，公平对待旗下管理的有关基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行公平交易和同向交易价差专项分析。

本报告期内，内两组合同单日、3日、5日时间窗口内同向交易大额价差均值或高出溢价率值显著不为0的情况不存在，并且交易占优比例没有明显异常，未发现不公平对待组合或组合间同向交易价差的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内本基金管理人管理的有关投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交总量的注：3. 所有者权益(基金净值)变动表

项目	期初数	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上年度末2018年12月31日
资产			
货币资金	533,608.30	62,116,476.61	
交易性金融资产	17,312.00		
可供出售金融资产	2,609,012,800.00	126,612,146.30	
其中：股权投资	-	-	-
基金投资	-	-	-
债券投资	2,609,012,800.00	126,612,146.30	
资产支持证券投资	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-
买入返售金融资产	-	120,000,000.00	
应收款项	46,796,903.81	2,687,640.22	
预付款项	-	-	-
其他应收款	-	-	-
其他资产	92,606.64	-	-
负债和所有者权益	2,656,360,624.91	310,416,126.16	
负债总计	-	-	-
所有者权益	-	-	-
实收基金	-	-	-
未分配利润	1,997,019,068.94	310,400,028.48	
其他所有者权益合计	3,008,127,328.24	310,376,341.16	
负债和所有者权益总计	2,656,360,624.91	310,416,126.16	

注：1. 报告期末2019年6月30日，基金份额净值1.0191元，基金份额总额1,997,019,068.94份。

10 基金管理人

6.1 资产负债表

会计主体：南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金
报告截止日：2019年6月30日

项目	期末数	期初数
资产		
货币资金	533,608.30	62,116,476.61
交易性金融资产	17,312.00	
可供出售金融资产	2,609,012,800.00	126,612,146.30
其中：股权投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,609,012,800.00	126,612,146.30
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	120,000,000.00
应收款项	46,796,903.81	2,687,640.22
预付款项	-	-
其他应收款	-	-
其他资产	92,606.64	-
负债和所有者权益	2,656,360,624.91	310,416,126.16
负债总计	-	-
所有者权益	-	-
实收基金	-	-
未分配利润	1,997,019,068.94	310,400,028.48
其他所有者权益合计	3,008,127,328.24	310,376,341.16
负债和所有者权益总计	2,656,360,624.91	310,416,126.16

注：1. 报告期末2019年6月30日，基金份额净值1.0191元，基金份额总额1,997,019,068.94份。

11 基金管理人

6.2 利润表

会计主体：南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金
报告截止日：2019年1月1日至2019年6月30日

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上期2018年12月19日至2019年6月30日
一、收入	30,040,924.68	30,040,924.68
利息收入	29,096,188.24	29,096,188.24
其中：存款利息收入	164,329.89	164,329.89
债券利息收入	28,714,789.73	28,714,789.73
其他利息收入	-	-
公允价值变动收益	-	-
其他业务收入	-	-
其他收益	-	-
二、费用	6,297,937.57	6,297,937.57
1. 管理人费用	1,882,203.64	1,882,203.64
2. 托管费	627,410.22	627,410.22
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	16,296.46	16,296.46
5. 利息支出	3,679,848.85	3,679,848.85
6. 其他费用	2,672,089.40	2,672,089.40
7. 其他费用	81,327.22	81,327.22
8. 其他费用	10,818.00	10,818.00
三、利润总额(亏损总额)以“1”减“2”后的金额	24,752,987.08	24,752,987.08
减：所得税费用	-	-
净利润(净亏损)以“3”减“4”后的金额	24,752,987.08	24,752,987.08

注：南方畅利于2018年12月19日成立，故无上年度可比期间数据。

12 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金
报告截止日：2019年1月1日至2019年6月30日

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上期2018年12月19日至2019年6月30日
一、实收基金	310,400,028.48	310,400,028.48
二、未分配利润	1,686,618,040.46	1,686,618,040.46
三、所有者权益合计	1,997,019,068.94	1,997,019,068.94

注：南方畅利于2018年12月19日成立，故无上年度可比期间数据。

13 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金
报告截止日：2019年1月1日至2019年6月30日

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上期2018年12月19日至2019年6月30日
一、收入	30,040,924.68	30,040,924.68
利息收入	29,096,188.24	29,096,188.24
其中：存款利息收入	164,329.89	164,329.89
债券利息收入	28,714,789.73	28,714,789.73
其他利息收入	-	-
公允价值变动收益	-	-
其他业务收入	-	-
其他收益	-	-
二、费用	6,297,937.57	6,297,937.57
1. 管理人费用	1,882,203.64	1,882,203.64
2. 托管费	627,410.22	627,410.22
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	16,296.46	16,296.46
5. 利息支出	3,679,848.85	3,679,848.85
6. 其他费用	2,672,089.40	2,672,089.40
7. 其他费用	81,327.22	81,327.22
8. 其他费用	10,818.00	10,818.00
三、利润总额(亏损总额)以“1”减“2”后的金额	24,752,987.08	24,752,987.08
减：所得税费用	-	-
净利润(净亏损)以“3”减“4”后的金额	24,752,987.08	24,752,987.08

注：南方畅利于2018年12月19日成立，故无上年度可比期间数据。

14 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金
报告截止日：2019年1月1日至2019年6月30日

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上期2018年12月19日至2019年6月30日
一、收入	30,040,924.68	30,040,924.68
利息收入	29,096,188.24	29,096,188.24
其中：存款利息收入	164,329.89	164,329.89
债券利息收入	28,714,789.73	28,714,789.73
其他利息收入	-	-
公允价值变动收益	-	-
其他业务收入	-	-
其他收益	-	-
二、费用	6,297,937.57	6,297,937.57
1. 管理人费用	1,882,203.64	1,882,203.64
2. 托管费	627,410.22	627,410.22
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	16,296.46	16,296.46
5. 利息支出	3,679,848.85	3,679,848.85
6. 其他费用	2,672,089.40	2,672,089.40
7. 其他费用	81,327.22	81,327.22
8. 其他费用	10,818.00	10,818.00
三、利润总额(亏损总额)以“1”减“2”后的金额	24,752,987.08	24,752,987.08
减：所得税费用	-	-
净利润(净亏损)以“3”减“4”后的金额	24,752,987.08	24,752,987.08

注：南方畅利于2018年12月19日成立，故无上年度可比期间数据。

15 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金
报告截止日：2019年1月1日至2019年6月30日

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上期2018年12月19日至2019年6月30日
一、收入	30,040,924.68	30,040,924.68
利息收入	29,096,188.24	29,096,188.24
其中：存款利息收入	164,329.89	164,329.89
债券利息收入	28,714,789.73	28,714,789.73
其他利息收入	-	-
公允价值变动收益	-	-
其他业务收入	-	-
其他收益	-	-
二、费用	6,297,937.57	6,297,937.57
1. 管理人费用	1,882,203.64	1,882,203.64
2. 托管费	627,410.22	627,410.22
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	16,296.46	16,296.46
5. 利息支出	3,679,848.85	3,679,848.85
6. 其他费用	2,672,089.40	2,672,089.40
7. 其他费用	81,327.22	81,327.22
8. 其他费用	10,818.00	10,818.00
三、利润总额(亏损总额)以“1”减“2”后的金额	24,752,987.08	24,752,987.08
减：所得税费用	-	-
净利润(净亏损)以“3”减“4”后的金额	24,752,987.08	24,752,987.08