南方广利回报债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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。

本报告中财务资料未经审计。

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。

本报告期自2019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	南方广利	
基金主代码	202105	
交易代码	202105	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年11月3日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	296,227,010.76份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方广利债券A/B	南方广利债券C
下属分级基金的交易代码	202105	202107
下属分级基金的前端交易代码	202105	
下属分级基金的后端交易代码	202106	
报告期末下属分级基金的份额总额	187,584,720.54份	108,642,290.22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“南方广利”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持资产流动性及有效控制风险的基础上,追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金管理人将以经济周期和宏观政策分析为前提,综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在债券、股票、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,定期或不定期地进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798

2.4 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.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§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

1、南方广利债券A/B

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	7,987,437.54
本期利润	15,740,733.01
加权平均基金份额本期利润	0.0748
本期基金份额净值增长率	5.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0659
期末基金资产净值	242,383,314.75
期末基金份额净值	1.292

2、南方广利债券C

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	4,262,128.97
本期利润	7,900,607.57
加权平均基金份额本期利润	0.0696
本期基金份额净值增长率	5.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0947
期末基金资产净值	136,710,767.48
期末基金份额净值	1.258

注:1、基金业绩指标不包括持有人认(申)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;

2、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;

3、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

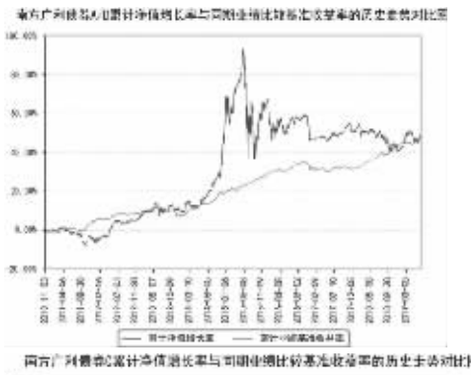
南方广利债券A/B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.65%	0.42%	0.57%	0.03%	1.08%	0.39%
过去三个月	-0.92%	0.41%	0.63%	0.06%	-1.55%	0.35%
过去六个月	5.81%	0.39%	2.07%	0.06%	3.74%	0.33%
过去一年	0.00%	0.46%	6.46%	0.06%	-6.46%	0.40%
过去三年	-3.87%	0.38%	11.13%	0.08%	-15.00%	0.30%
自基金合同生效起至今	48.53%	0.79%	46.02%	0.09%	2.51%	0.70%

南方广利债券C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.62%	0.41%	0.57%	0.03%	1.05%	0.38%
过去三个月	-1.10%	0.40%	0.63%	0.06%	-1.73%	0.34%
过去六个月	5.63%	0.38%	2.07%	0.06%	3.56%	0.32%
过去一年	-0.40%	0.46%	6.46%	0.06%	-6.86%	0.40%
过去三年	-4.98%	0.38%	11.13%	0.08%	-16.11%	0.30%
自基金合同生效起至今	44.88%	0.79%	46.02%	0.09%	-1.14%	0.70%

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



§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

1998年3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“新基金时代”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%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)2.20%。目前,公司在北京、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成立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8800亿元,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)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘文良	本基金基金经理	2016年6月24日	-	6年	北京大学金融学专业硕士,具有基金从业资格。2012年7月加入南方基金,历任固定收益部转债研究员、宏观研究员、信用分析师;2015年2月至2015年8月,任南方永利基金经理助理;2015年12月至2017年2月,任南方弘利基金经理;2015年12月至2017年5月,任南方安心基金经理;2016年11月至2018年2月,任南方荣发基金经理;2016年11月至2018年2月,任南方卓元基金经理;2017年5月至2018年7月,任南方和利、南方和元、南方纯元基金经理;2017年6月至2018年7月,任南方高元基金经理;2017年8月至2019年1月,任南方祥元基金经理;2017年9月至2019年1月,任南方兴利基金经理;2015年8月至今,任南方永利基金经理;2016年6月至今,任南方广利基金经理;2016年7月至今,任南方甑智混合基金经理;2018年3月至今,任南方希元转债基金经理;2019年3月至今,任南方多元基金经理。

注:1、本基金首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,基金运作整体合法合规,没有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规定。

4.3 管理人对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基金和投资组合。 公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内,两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在,并且交易占优比也没有明显异常,未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为5次,是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数成分股调整所致。

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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年全球货币政策由紧转松,美联储公布结束缩表路线图,并暗示三季度启动降息,中美贸易谈判先扬后抑,5月初美国加征关税成为转折点,6月下旬G20峰会后重回谈判桌,国内宽信用的政策一季度初显成效,但二季度政策转向控制杠杆,稳增长力度下降,叠加贸易战升级经济下行压力加大,包商接管事件之后虽然央行资金供给充裕,但流动性分层和信用分层加剧。上半年利率债以震荡为主,利率曲线变动不大,信用债表现明显好于同期限国开债,信用利差压缩。上半年权益市场先扬后抑,一季度成长占优,二季度金融消费龙头占优,截止6月末沪深300指数上涨27.07%,中证500指数上涨18.77%,创业板指数上涨20.87%。可转债一季度估值修复,4月中下旬和6月上旬估值压缩,截止6月末中证转债指数上涨13.30%。2019年上半年,南方广利基金纯债部分以获取信用债持有收益为主,保持了较高的杠杆和静态收益水平,一季度通过挖掘信用利差压缩的机会获取了一定的超额收益,二季度主要获取票息收益,权益部分积极参与股票和可转债行情,在春节前后和6月中上旬两次提高了权益类仓位,虽然4、5月受市场调整影响有一定回撤,但上半年整体仍明显增厚了组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金B份额净值为1.292元,报告期内,份额净值增长率为5.81%,同期业绩基准增长率为2.07%;本基金C份额净值为1.258元,报告期内,份额净值增长率为5.63%,同期业绩基准增长率为2.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

纯债方面,三季度经济基本面下行压力较大,基建托底大概率难抵出口链条和地产链条的下滑,货币政策维持宽松,流动性合理充裕,当前货币政策的重点在于疏通传导机制,降低实体融资成本,但包商银行接管事件带来的流动性分层和信用分层对宽信用的落地存在一定的抑制,需要观察政策对冲的方式、节奏和力度。整体来看,当前基本面和政策面有利于债券市场,但利率债和高等级信用债收益率已经接近年初低点,下行空间亦有限,中低等级信用债在质押融资能力下降、信用分层背景下可能出现利差抬升,需要严格梳理信用风险,控制好集中度和流动性。权益方面,二季度市场对于稳增长力度减弱、中美贸易战升级、包商银行接管事件连锁反应三轮冲击给与了较为充分的悲观预期,预计三季度上述因素至少有1-2个出现边际改善,叠加科创板推出、鼓励提高直接融资权重的政策陆续落地和70周年国庆临近,有望出现一轮风险偏好上升驱动的行情,结构上看好前期受到压制的科技成长龙头,以及中报业绩优异、估值合理的稳定增长标的。6月可转债市场估值回落至低位,攻守兼备的特性明显恢复,风险收益比好的可选标的明显增加,具备较好的配置价值。2019年三季度,南方广利基金纯债方面将在严格控制信用风险的前提下,坚持以获取信用债持有收益为主的策略,适当利用杠杆提高组合静态收益,权益方面积极把握市场行情,精选个券,力争增厚组合收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度,明确基金估值的程序和技术;建立了估值委员会,组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统,估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术,导致基金资产净值的变化在0.25%以上的,对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理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。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,由于本基金A类/B类基金份额不收取销售服务费,而C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;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,每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的10%;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内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量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对南方广利回报债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,南方广利回报债券证券投资基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方广利回报债券证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,南方广利回报债券证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方广利回报债券证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:南方广利回报债券型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末2019年6月30日	上年度末2018年12月31日
资产:		
银行存款	639,059.06	673,837.19
结算备付金	4,937,095.76	11,671,130.20
存出保证金	112,274.68	68,661.69
交易性金融资产	508,728,867.92	485,726,612.30
其中:股票投资	57,776,786.40	40,226,370.21
基金投资	-	-
债券投资	450,952,081.52	442,486,842.09
资产支持证券投资	-	3,013,400.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	823,792.84	7,484,494.42
应收利息	7,775,252.30	9,025,305.31
应收股利	-	-
应收申购款	8,906.21	12,098.74
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	523,025,248.77	514,662,139.85
负债和所有者权益	本期末2019年6月30日	上年度末2018年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	142,111,499.98	100,899,850.60
应付证券清算款	697,912.41	7,546,004.53
应付赎回款	444,529.90	439,403.51
应付管理人报酬	200,623.64	237,704.62
应付托管费	61,730.33	73,139.89
应付销售服务费	44,668.79	46,913.84
应付交易费用	178,448.38	203,550.00
应交税费	43,502.76	55,349.81
应付利息	58,192.00	2,183.20
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	90,058.35	355,044.91
负债合计	143,931,166.54	109,859,144.91
所有者权益:		
实收基金	296,227,010.76	333,876,429.86
未分配利润	82,867,071.47	70,926,565.08
所有者权益合计	379,094,082.23	404,802,994.94
负债和所有者权益总计	523,025,248.77	514,662,139.85

注:报告截止日2019年6月30日,南方广利债券A/B份额净值1.292元,基金份额总额187,584,720.54份;南方广利债券C份额净值1.258元,基金份额总额108,642,290.22份;总份额合计296,227,010.76份。

6.2 利润表

会计主体:南方广利回报债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	28,445,363.60	-547,864.23
1.利息收入	10,686,889.59	14,780,464.66
其中:存款利息收入	73,452.71	101,252.94
债券利息收入	10,597,157.83	14,663,762.38
资产支持证券利息收入	16,279.05	-
买入返售金融资产收入	-	15,449.34
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	6,354,826.02	-15,952,838.84
其中:股票投资收益	4,183,488.72	-12,238,396.15
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,720,646.14	-4,704,403.35
资产支持证券投资收益	30,115.07	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	420,576.09	989,960.66
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	11,391,774.07	621,012.59
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	11,873.92	3,497.36
减:二、费用	4,804,023.02	6,795,269.94
1.管理人报酬	1,320,162.36	1,735,208.93
2.托管费	406,203.80	533,910.37
3.销售服务费	280,071.83	363,546.27
4.交易费用	733,145.68	1,088,995.04
5.利息支出	1,914,858.75	2,819,489.14
其中:卖出回购金融资产支出	1,914,858.75	2,819,489.14
6.税金及附加	36,844.63	50,654.37
7.其他费用	112,735.97	203,465.82
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	23,641,340.58	-7,343,134.17
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	23,641,340.58	-7,343,134.17

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方广利回报债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期2019年1月1日至2019年6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)	333,876,429.86	70,926,565.08	404,802,994.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,641,340.58	23,641,340.58
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)	-37,649,419.10	-11,700,834.19	-49,350,253.29
其中:1.基金申购款	34,610,533.72	7,625,229.51	42,235,763.23
2.基金赎回款	-72,259,952.82	-19,326,063.70	-91,586,016.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	296,227,010.76	82,867,071.47	379,094,082.23
项目	上年度可比期间2018年1月1日至2018年6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)	460,396,773.90	138,957,737.39	599,354,511.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,343,134.17	-7,343,134.17
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)	-77,548,116.54	-23,745,507.96	-101,293,624.50
其中:1.基金申购款	20,685,811.27	6,363,989.01	27,049,800.28
2.基金赎回款	-98,233,927.81	-30,109,496.97	-128,343,424.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	382,848,657.36	107,869,095.26	490,717,752.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

___杨小松___ ___徐超___ ___徐超___

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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明

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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	95,751,932.18	19.65%	40,514,177.23	5.60%

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	83,987.84	19.27%	83,987.84	49.77%
	上年度可比期间2018年1月1日至2018年6月30日			
关联方名称	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	36,268.32	5.54%	-	-

注:1.上述佣金按市场佣金率计算。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,320,162.36	1,735,208.93
其中:支付销售机构的客户维护费	195,091.60	445,404.06

注:支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.65%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.65%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	406,203.80	533,910.37

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,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 × 0.20%/当年天数。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方广利债券A/B	南方广利债券C	合计
工商银行	-	94,147.70	94,147.70
华泰证券	-	2,400.14	2,400.14
南方基金	-	79,857.78	79,857.78
合计	-	176,405.62	176,405.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方广利债券A/B	南方广利债券C	合计
华泰证券	-	2,581.09	2,581.09
工商银行	-	110,779.40	110,779.40
南方基金	-	123,805.77	123,805.77
兴业证券	-	22.75	22.75
合计	-	237,189.01	237,189.01

注:支付销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给南方基金,再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A/B类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为:

日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2 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

无。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	639,059.06	7,338.44	4,200,307.28	11,414.07

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,按银行约定利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.2 受限证券类别:债券											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注	
113027	华钰转债	2019年6月18日	2019年7月10日	新债未上市	100.00	100.00	2,600	260,000.00	260,000.00	-	
123028	清水转债	2019年6月21日	2019年7月15日	新债未上市	100.00	100.00	3,010	301,000.00	301,000.00	-	

1、基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。2、基金还可作为特定投资者,认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份,所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额40,011,499.98元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
101661032	16南山集MTN002	2019年7月3日	100.06	48,000	4,802,880.00
101800578	18振业集团MTN001	2019年7月3日	102.70	100,000	10,270,000.00
101900128	19漯水城建MTN002	2019年7月3日	100.67	100,000	10,067,000.00
190201	19国开01	2019年7月3日	99.96	210,000	20,991,600.00
合计	-	-	-	458,000	46,131,480.00

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额102,100,000.00元,截至2019年7月2日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	57,776,786.40	11.05
	其中:股票	57,776,786.40	11.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	450,952,081.52	86.22
	其中:债券	450,952,081.52	86.22
	资产支持证券	-	-
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	5,576,154.82	1.07
8	其他资产	8,720,226.03	1.67
9	合计	523,025,248.77	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

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	14,200.00	0.00
C	制造业	55,531,001.20	14.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐