

南方军工改革灵活配置混合型证券投资基金

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：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2019年8月23日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国农业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。

本报告期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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方军工混合
基金代码	000224
交易代码	000224
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月8日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	763,426,581.06份
基金合同延续期	不定期

本基金在交易所系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方军工”。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制组合风险保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定量和定性的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，结合对宏观经济、行业、区域、公司等的深入研究，通过资产配置、行业配置、个股选择等投资策略，形成资产组合，力争在保持基金资产流动性相对稳定的情况下，实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	中证军工指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于货币型基金，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	中国农业银行股份有限公司
姓名	常克川	贾鹤
信息披露负责人	联系电话 0756-82763888 电子邮箱 manager@sofiafund.com 客户服务电话 400-891-8899 传真 0756-82763889	010-66000009 tgcx@cbocn.com 010-68121816

§ 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

金额单位：人民币元

3.1.1 利润数据和指标	报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)
本期已实现收益	-103,054,294.02
本期利润	76,179,017.18
加权平均基金份额本期利润	0.0003
本期基金份额净值增长率为	19.82%

3.1.2 利润数据和指标

报告期末(2019年6月30日)

期末可供分配利润

-0.3066

期末基金资产净值

530,224,982.64

期末基金份额净值

0.9945

注：1. 基金业绩指标不包括持有人认(申)购或交易基金的当期费用，计入费用后实际收益水平将低于所列示数据；

2. 本期已实现收益指基金本期利润减去费用后的余额，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

阶段 份额净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)

过去一个月 0.17% -1.20% 1.00% 0.46% 0.12%

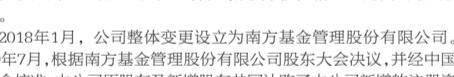
过去一个月 -7.64% 1.70% 1.76% 0.11% 0.16%

过去一个月 19.92% 1.80% 10.41% 1.58% 3.41% 0.22%

过去一年 9.97% 1.78% 6.46% 1.51% 3.41% 0.27%

自基金合同生效以来 -30.66% 1.58% -26.63% 1.36% -4.92% 0.23%

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1月31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批准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占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%、厦门华泽资产管理有限公司1.21%、厦门华泽资产管理合伙企业(有限合伙)1.21%、厦门华泽企业管理合伙企业(有限合伙)2.11%、厦门华泽盈盛企业管理合伙企业(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19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)及其基金经理助理简介

姓名 职务 任期本基金基金经理 (任职期限) 任期本基金基金经理 (任职期限)

常克川 本基金基金经理 2019年3月29日 11年

魏超 本基金基金经理 2017年3月29日 12年

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值0.6945元，基金份额总额763,458,519.95份。

6.2 利润表

会计主体：南方军工改革灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产 附注号 本期末2019年6月30日 年度末2018年12月31日

货币资金 14,541,621.99 62,250,222.29

拆借资金 983,798.19 97,126.08

存出保证金 156,656.00 96,106.13

交易性金融资产 516,948,594.35 340,008,163.63

其中：股票投资 406,939,594.35 340,008,163.63

基金投资 -

债券投资 40,112.03

贵金属投资 -

衍生金融资产 3,084.90

应收利息 1,994,791.19 1,512,157.52

应收股利 648,115.36 630,562.91

应收申购款 108,019.24 88,421.75

应付赎回款 -

应付交易费用 464,492.07 94,594.09

应付利息 441,239.49 11,846.46

应付股利 683,514.28 467,302.51

应付申购款 -

其他资产 -

资产总计 633,526,413.18 403,759,952.73

负债 附注号 本期末2019年6月30日 年度末2018年12月31日

短期借款 14,541,621.99 62,250,222.29

拆入资金 140,493.81 140,493.81

应付票据 3,084.90 3,084.90

应付账款 1,994,791.19 1,512,157.52

应付职工薪酬 648,115.36 630,562.91

应付手续费及佣金 108,019.24 88,421.75

应付交易费用 464,492.07 94,594.09

应付利息 441,239.49 11,846.46

应付股利 683,514.28 467,302.51

应付申购款 -

其他负债 -

负债总计 633,526,413.18 403,759,952.73

净资产 附注号 本期末2019年6月30日 年度末2018年12月31日

基金资产净值 763,426,581.95 399,719,017.18

基金份额净值 0.9945 0.9945

货币市场基金 0.9945 0.9945

负债净值 633,526,413.18 403,759,952.73

净资产总额 763,426,581.95 399,719,017.18

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决定的公告(生效)日期；

2. 本基金从业年限计算方法从行业协会《证券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合规性情况的专项说明

本基金报告期内，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的基⾦合同的规定，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取最大利益。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、投资比例及投基⾦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

本基金报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金公平交易制度及流程》，公平对待旗下管理的所有基金及投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易公平性分析。

本基金报告期内，两两组合间日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率或卖出溢价率均显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，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 相关交易行为的专项说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》中关于证券