# 南方君信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:中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

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

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 南方君信灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 005741 |
| 交易代码 | 005741 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年5月30日 |
| 基金管理人 | 南方基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 136,498,918.93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揭示等其他信息披露场合下,可简称为“南方君信”。

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在严格控制组合风险并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定增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用“自上而下”的分析视角,综合考量中国宏观经济发展前景、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI与PPI变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素,分析研判货币市场、债券市场与股票市场的预期收益与风险,并据此进行大类资产的配置与组合构建,合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例,并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化,适时动态地调整各金融工具的投资比例。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×50%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%+上证国债指数收益率×30% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,一般而言,其预期风险收益水平高于债券基金与货币市场型基金,低于股票型基金。本基金可投资港股通股票,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |

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 | 中信银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 常克川 | 李修滨 |
| | 联系电话 | 0755-82763888 | 4006800000 |
| | 电子邮箱 | manager@southern-fund.com | lixiubin@citicbank.com |
| 客户服务电话 | | 400-889-8899 | 95558 |
| 传真 | | 0755-82763889 | 010-85230024 |

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

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 | 19,346,151.72 |
| 本期利润 | 26,705,433.80 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1892 |
| 本期基金份额净值增长率 | 11.59% |
| 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 | 149,428,665.09 |
| 期末基金份额净值 | 1.0947 |

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;

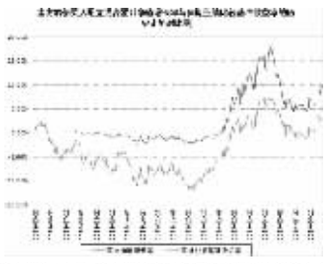
3、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

| 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 | 3.34% | 0.87% | 3.88% | 0.73% | -0.54% | 0.14% |
| 过去三个月 | -2.65% | 1.20% | -0.34% | 0.89% | -2.31% | 0.31% |
| 过去六个月 | 11.59% | 1.16% | 16.35% | 0.92% | -4.76% | 0.24% |
| 过去一年 | 9.38% | 0.83% | 6.48% | 0.94% | 2.90% | -0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.47% | 0.79% | 3.22% | 0.93% | 6.25% | -0.14% |

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



注:本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## §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 | | |
| 茅炜 | 本基金基金经理 | 2018年5月30日 | - | 11年 | 上海财经大学保险学学士,具有基金从业资格。曾任职于东方人寿保险公司及生命人寿保险公司,担任保险精算员,在国金证券研究所任职期间,担任保险及金融行业研究员。2009年加入南方基金,历任研究部保险及金融行业研究员、研究部总监助理、副总监、执行总监、总监,现任权益研究部总经理、境内权益投资决策委员会委员;2012年10月至2016年1月,兼任专户投资管理部投资经理;2016年2月至今,任南方君选基金经理;2018年2月至今,任南方教育股票基金经理;2018年5月至今,任南方君信混合基金经理;2018年6月至今,任南方医保基金经理;2019年3月至今,任南方军工混合基金经理;2019年5月至今,任南方科技创新混合基金经理;2019年6月至今,任南方信息创新混合基金经理。 |

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,政策暖风、估值低位、加入MSCI预期、中美谈判进展、基建托底支撑、改革逐步落地、减税持续推进等逐渐成为市场上涨驱动力,市场整体表现为上涨趋势。进入2019年2季度,由于1季度市场大幅上涨,超跌股估值修复基本完成、优质白马股估值也不便宜,市场累积了一定的风险,有回调的需求;但由于有国内托底政策、加入MSCI预期、减税持续推进等利好支撑,市场也很难趋势性下跌,上证指数大概率会围绕3000点附近震荡。南方君信作为一直次新基金,在积累了足够的安全垫后,2月进行了大幅加仓,后续南方君信股票仓位维持在基准附近,不会偏离基准太多,重点在于积调整个股结构,减持了基本面恶化的个股,增持了部分业绩超预期的的优质股票。行业配置上,以均衡配置为主,重点在于精选未来业绩确定性强并且高速增长的股票,赚取业绩增长所带来的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0947元,报告期内,份额净值增长率为11.59%,同期业绩基准增长率为16.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济下行压力加大,货币政策有望“保持流动性合理充裕”,财政政策有望出台“拓展扩大最终需求”和“稳定制造业投资”等一系列措施;在加快推进信息网络等新型基础设施建设的背景下,有很多行业尤其是科技行业有望出现景气拐点;美联储降息落地,全球进入宽松周期,整体宏观流动性环境保持偏宽松,叠加贸易摩擦缓和,利好人民币阶段性升值,外资有望继续回流;在反复强调“房住不炒”的大背景下,居民资金有望通过银行理财、公私募基金等方式直接或间接进入股票市场。居于以上判断,基金经理对A股市场未来走势谨慎乐观。从结构上来看,成长板块的性价比更高,行业层面看好电子、非银、通信。

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,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,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人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;若投资人不选择,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;每一基金份额享有同等分配权;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

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对南方君信灵活配置混合型证券投资基金2019年上半年的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,履行了托管人的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,南方基金管理股份有限公司在南方君信灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的2019年半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §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:南方君信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 | 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 | 3,453,024.60 | 16,710,853.02 |
| 结算备付金 | 2,575,377.65 | 7,919,545.45 |
| 存出保证金 | 177,678.85 | 99,548.96 |
| 交易性金融资产 | 122,443,543.26 | 128,892,115.65 |
| 其中:股票投资 | 116,282,552.66 | 52,199,950.45 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 6,160,990.60 | 76,692,165.20 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 20,000,000.00 | 89,200,000.00 |
| 应收证券清算款 | 5,515.07 | - |
| 应收利息 | 65,854.57 | 787,044.28 |
| 应收股利 | 38,593.84 | - |
| 应收申购款 | 3,239,607.67 | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 151,999,195.51 | 243,609,107.36 |
| 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 | - | - |
| 应付证券清算款 | 1.75 | 6,426,077.95 |
| 应付赎回款 | 2,143,169.43 | - |
| 应付管理人报酬 | 172,470.91 | 306,521.78 |
| 应付托管费 | 28,745.15 | 51,086.94 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 133,342.39 | 63,234.57 |
| 应交税费 | 3.87 | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 92,796.92 | 220,000.00 |
| 负债合计 | 2,570,530.42 | 7,066,921.24 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 136,498,918.93 | 241,121,982.68 |
| 未分配利润 | 12,929,746.16 | -4,579,796.56 |
| 所有者权益合计 | 149,428,665.09 | 236,542,186.12 |
| 负债和所有者权益总计 | 151,999,195.51 | 243,609,107.36 |

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0947元,基金份额总额136,498,918.93份。

6.2 利润表

会计主体:南方君信灵活配置混合型证券投资基金

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5月30日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 28,890,933.02 | 809,540.00 |
| 1.利息收入 | 887,290.17 | 648,737.29 |
| 其中:存款利息收入 | 87,291.51 | 125,966.57 |
| 债券利息收入 | 407,105.77 | 55,694.99 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 392,892.89 | 467,075.73 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | 20,347,671.12 | 120,609.46 |
| 其中:股票投资收益 | 19,083,232.39 | 120,609.46 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 61,811.95 | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 1,202,626.78 | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 7,359,282.08 | 33,247.83 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 296,689.65 | 6,945.42 |
| 减:二、费用 | 2,185,499.22 | 544,894.21 |
| 1.管理人报酬 | 1,105,706.64 | 430,460.05 |
| 2.托管费 | 184,284.44 | 71,743.33 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 777,058.66 | 9,357.39 |
| 5.利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6.税金及附加 | 0.41 | - |
| 7.其他费用 | 118,449.07 | 33,333.44 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 26,705,433.80 | 264,645.79 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | 26,705,433.80 | 264,645.79 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方君信灵活配置混合型证券投资基金

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) | 241,121,982.68 | -4,579,796.56 | 236,542,186.12 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 26,705,433.80 | 26,705,433.80 |
| 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) | -104,623,063.75 | -9,195,891.08 | -113,818,954.83 |
| 其中:1.基金申购款 | 89,617,475.02 | 5,724,030.38 | 95,341,505.40 |
| 2.基金赎回款 | -194,240,538.77 | -14,919,921.46 | -209,160,460.23 |
| 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) | 136,498,918.93 | 12,929,746.16 | 149,428,665.09 |
| 项目 | 上年度可比期间2018年5月30日(基金合同生效日)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) | 337,773,295.06 | - | 337,773,295.06 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 264,645.79 | 264,645.79 |
| 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) | - | - | - |
| 其中:1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 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) | 337,773,295.06 | 264,645.79 | 338,037,940.85 |

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 |
| 中信银行股份有限公司(“中信银行”) | 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5月30日(基金合同生效日)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 | 518,511,759.91 | 100.00% | 6,185,793.46 | 100.00% |

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内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 | 471,271.26 | 100.00% | 133,342.39 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间2018年5月30日(基金合同生效日)至2018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 | 5,637.08 | 100.00% | 5,637.08 | 100.00% |

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5月30日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,105,706.64 | 430,460.05 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 330,749.95 | - |

注:支付基金管理人南方基金管理股份有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.50%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:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷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5月30日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 184,284.44 | 71,743.33 |

注:支付基金托管人中信银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%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:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数

6.4.4.2.3 销售服务费

无。

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5月30日(基金合同生效日)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 |
| 中信银行 | 3,453,024.60 | 51,973.96 | 187,590,808.65 | 125,145.63 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中信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 | |
| 300788 | 中信出版 | 2019年6月27日 | 2019年7月5日 | 新股未上市 | 14.85 | 14.85 | 1,556 | 23,106.60 | 23,106.60 | - | |
| 601236 | 红塔证券 | 2019年6月26日 | 2019年7月5日 | 新股未上市 | 3.46 | 3.46 | 9,789 | 33,869.94 | 33,869.94 | - | |
| 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 | |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |

注: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。

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

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## §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 | 116,282,552.66 | 76.50 |
| | 其中:股票 | 116,282,552.66 | 76.50 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 6,160,990.60 | 4.05 |
| | 其中:债券 | 6,160,990.60 | 4.05 |
| | 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 | 20,000,000.00 | 13.16 |
| | 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 | 6,028,402.25 | 3.97 |
| 8 | 其他资产 | 3,527,250.00 | 2.32 |
| 9 | 合计 | 151,999,195.51 | 100.00 |

注:本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股市值为人民币7,895,898.53元,占基金资产净值比例5.28%。

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 | 3,680,670.40 | 2.46 |
| B | 采矿业 | 6,127,370.60 | 4.10 |
| C | 制造业 | 39,976,413.10 | 26.75 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 5,910,425.00 | 3.96 |
| F | 批发和零售业 | 2,364,988.74 | 1.58 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,130,578.00 | 2.10 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,281,602.51 | 2.87 |
| J | 金融业 | 35,614,111.18 | 23.83 |
| K | 房地产业 | 5,275,080.00 | 3.53 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,002,308.00 | 1.34 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| 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 | 0.02 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 108,396,654.13 | 72.53 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位:人民币元

| 行业类别 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 能源 | - | - |
| 材料 | - | - |
| 工业 | 1,207,139.82 | 0.81 |
| 非必需消费 | - | - |
| 必需消费品 | - | - |
| 医疗保健 | - | - |
| 金融 | 4,592,880.79 | 3.07 |
| 科技 | 930,504.35 | 0.62 |
| 通讯 | - | - |
| 公用事业 | 1,165,373.57 | 0.78 |
| 政府 | - | - |
| 合计 | 7,895,898.53 | 5.28 |

注:以上分类采用彭博行业分类标准(BICS)。

7.3 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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601939 | 建设银行 | 834,000 | 6,204,960.00 | 4.15 |
| 2 | 601398 | 工商银行 | 1,034,800 | 6,094,972.00 | 4.08 |
| 3 | 601668 | 中国建筑 | 1,027,900 | 5,910,425.00 | 3.96 |
| 4 | 000001 | 平安银行 | 357,800 | 4,930,484.00 | 3.30 |
| 5 | 01336 | 新华人寿保险股份有限公司 | 137,400 | 4,592,880.79 | 3.07 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 49,800 | 4,412,778.00 | 2.95 |
| 7 | 601128 | 常熟银行 | 556,513 | 4,296,280.36 | 2.88 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 212,300 | 3,882,967.00 | 2.60 |
| 9 | 300498 | 温氏股份 | 102,640 | 3,680,670.40 | 2.46 |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 268,300 | 3,423,508.00 | 2.29 |

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于http://www.nffund.com的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601128 | 常熟银行 | 11,107,771.99 | 4.70 |
| 2 | 601668 | 中国建筑 | 10,162,871.20 | 4.30 |
| 3 | 000977 | 浪潮信息 | 10,036,037.00 | 4.24 |
| 4 | 601939 | 建设银行 | 9,032,894.00 | 3.82 |
| 5 | 01336 | 新华人寿保险股份有限公司 | 7,774,017.12 | 3.29 |
| 6 | 601009 | 南京银行 | 7,276,694.00 | 3.08 |
| 7 | 300571 | 平治信息 | 6,810,710.80 | 2.88 |
| 8 | 300498 | 温氏股份 | 5,977,284.16 | 2.53 |
| 9 | 601766 | 中国中车 | 5,902,307.00 | 2.50 |
| 10 | 601398 | 工商银行 | 5,877,864.00 | 2.48 |
| 11 | 002925 | 盈趣科技 | 4,963,300.18 | 2.10 |
| 12 | 600048 | 保利地产 | 4,620,150.88 | 1.95 |
| 13 | 002456 | 欧菲光 | 4,611,532.14 | 1.95 |
| 14 | 601333 | 广深铁路 | 4,605,481.14 | 1.95 |
| 15 | 002384 | 东山精密 | 4,599,958.00 | 1.94 |
| 16 | 002563 | 森马服饰 | 4,564,064.00 | 1.93 |
| 17 | 000001 | 平安银行 | 4,550,996.11 | 1.92 |
| 18 | 601166 | 兴业银行 | 4,111,332.00 | 1.74 |
| 19 | 000002 | 万科A | 4,056,072.32 | 1.71 |
| 20 | 601318 | 中国平安 | 3,878,213.00 | 1.64 |

注:买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 000977 | 浪潮信息 | 8,722,838.86 | 3.69 |
| 2 | 601128 | 常熟银行 | 6,852,193.50 | 2.90 |
| 3 | 300571 | 平治信息 | 6,569,805.50 | 2.78 |
| 4 | 002384 | 东山精密 | 5,880,333.76 | 2.49 |
| 5 | 300114 | 中航电测 | 5,769,420.22 | 2.44 |
| 6 | 002831 | 裕同科技 | 5,726,648.00 | 2.42 |
| 7 | 002456 | 欧菲光 | 5,656,694.37 | 2.39 |
| 8 | 002925 | 盈趣科技 | 5,536,355.00 | 2.34 |
| 9 | 300122 | 智飞生物 | 5,468,859.49 | 2.31 |
| 10 | 601600 | 中国铝业 | 5,373,207.00 | 2.27 |
| 11 | 300031 | 宝通科技 | 5,224,403.28 | 2.21 |
| 12 | 601009 | 南京银行 | 5,156,008.25 | 2.18 |
| 13 | 002138 | 顺络电子 | 5,115,332.80 | 2.16 |
| 14 | 002376 | 新北洋 | 5,046,571.42 | 2