

南方人工智能主题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、监事及高级管理人员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。

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。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方人工智能主题混合
基金代码	000720
交易币种	人民币
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月12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
报告期末基金资产净值	51,790,000.38
基金份额净值	1.0000

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“南方人工智能主题混合”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为契约型开放式证券投资基金, 资金投资主要投资于精选的人工智能主题股票, 通过股票、债券、现金类资产的配置, 力求为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的收益。
基金主要投资策略	本基金将主要通过分析宏观经济、政策、周期以及行业事件进行研究, 抓取未来的投资机会, 通过股票、债券、现金类资产的配置, 力求为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	沪深300指数×60%+中证港股通综合指数(人民币)×20%+中证债券指数×20%+0.25%。
风险收益特征	本基金为混合型基金, 属于中高风险、中高收益的基金品种, 其预期风险和预期收益水平高于股票型基金, 低于债券型基金。
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	常屹川	贾超
联系电话	010-52613899	010-60000000
电子邮箱	manag@outhfund.com	tpxq@abchina.com
客户服务电话	400-889-8899	95599
传真	010-60121016	010-60121016

2.4 信息披露方式

基金份额净值报告的正刊在基金管理人互联网网址

http://www.nffund.com

基金份额净值报告备查地点

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

本期数据和指标		报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)	
本期实现收益		10,093,416.12	
本期利润		14,639,473.05	
加权平均基金份额本期利润		0.2791	
3.12 期末可供分配基金份额利润		0.2897	
3.13 期末可供分配利润		64,169,261.01	1.2807
3.14 基金期末可供分配利润			

注:本基金不收取基金管理费。

5.1 报告期内本基金不包括持有人认(申)购或交易本基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

2. 本期已实现收益指本基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣减相关费用后的余额, 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, 采用期末资产负责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

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

在托管本基金的过程中, 本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定, 对本基金基金管理人、南方基金管理有限公司2019年1月1日至2019年6月30日基金的投资运作、进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督, 认真履行了托管人的义务, 没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本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, 南方基金管理有限公司在本基金的投资运作、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。

5.4 管理人对报告期内财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:南方人工智能主题混合型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

金额单位: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)
银行存款	11,694,160.92	10,995,660.30
结算备付金	440,761.00	5,706,220.00
存出保证金	67,338.00	6,486.04
交易性金融资产	13,892,601.43	31,474,690.20
其中:股票投资	13,892,601.43	31,474,690.20
债券投资	-	-
贵金属投资	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	-	-
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
其他应收款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付交易费用	192,698.00	40,692.00
应付税费	-	-
应付利润	-	-
应付股利	-	-
应付负债合计	89,600.00	199,000.00
所有者权益:		
实收基金	13,703,806.00	18,744,814.20
未分配利润	12,365,462.61	-1,500,463.70
所有者权益合计	64,169,261.01	62,281,330.41
负债和所有者权益总计	64,169,261.01	62,281,330.41

注:报告截止日2019年6月30日, 基金份额净值1.2387元, 基金份额总额51,793,805.38份。

6.2 利润表

会计主体:南方人工智能主题混合型证券投资基金

报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

金额单位:人民币元

项目	本期(2019年1月1日至2019年6月30日)
一、收入	15,926,284.17
其中:利息收入	110,732,000.00
手续费收入	72,762.41
投资收益	-
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
公允价值变动收益(收益以“+”号填列)	4,566,670.00
二、费用	10,764,666.22
其中:利息支出	-
手续费支出	-
佣金支出	-
手续费和佣金	-
交易费用	-
管理人报酬	-
托管费	-
申购费	-
赎回费	-
信息披露费	-
审计费	-
交易费用	-
其他费用	-
三、利润总额	5,161,627.95
减:所得税费用	14,639,473.16
四、净利润(亏损以“-”号填列)	-11,461,745.01

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方人工智能主题混合型证券投资基金

报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

金额单位:人民币元

项目	本期(2019年1月1日至2019年6月30日)
一、期初所有者权益(基金净资产) (基	51,793,805.38
二、本期利润	5,161,627.95
三、本期盈余分配	-11,461,745.01
四、期末所有者权益(基金净资产)	51,790,000.38

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, 后任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期;

2、本基金年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员执业资格管理暂行规定》, 本报告期, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规, 勉励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。

3、管理人对报告期内基金交易情况的专项说明

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执行公平交易, 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差价专项分析。

本报告期内, 两两组合简单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入盈率均显著不等于0的情况不存在, 并且交易占比也几乎没有明显异常, 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 异常交易行为的专项说明

本基金于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基金公开竞价同日反向交易成交金额占当期成交金额的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投资策略的说明