# 南方浙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:南方基金管理股份有限公司

基金托管人:浙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。

基金托管人浙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 | 南方浙利定开债券发起 |
| 基金主代码 | 005469 |
| 交易代码 | 005469 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年3月9日 |
| 基金管理人 | 南方基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 浙商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,307,158,411.70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“南方浙利”。

2.2 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。 |
| 投资策略 | 本基金将重点投资信用类债券,以提高组合收益能力。同时综合运用收益率曲线策略、债券回购投资策略、资产支持证券投资策略和开放期投资策略,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。 |
| 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,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,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 | 浙商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 常宏川 | 朱巍 |
| | 联系电话 | 0755-82763888 | 0571-87659806 |
| | 电子邮箱 | manager@southernfund.com | zhuwei@czbank.com |
| 客户服务电话 | | 400-889-8899 | 95527 |
| 传真 | | 0755-82763889 | 0571-87269881 |

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 | 94,736,422.15 |
| 本期利润 | 79,282,825.42 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0184 |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.79% |
| 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 | 0.0301 |
| 期末基金资产净值 | 4,451,482,096.31 |
| 期末基金份额净值 | 1.0335 |

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 | 0.44% | 0.02% | 0.28% | 0.03% | 0.16% | -0.01% |
| 过去三个月 | 0.63% | 0.04% | -0.24% | 0.06% | 0.87% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.79% | 0.04% | 0.24% | 0.06% | 1.55% | -0.02% |
| 过去一年 | 5.74% | 0.06% | 2.82% | 0.06% | 2.92% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.73% | 0.05% | 4.30% | 0.07% | 3.43% | -0.02% |

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 | | |
| 黄斌斌 | 本基金基金经理 | 2018年4月12日 | - | 8年 | 清华大学工学学士、新加坡管理大学经济学硕士,具有基金从业资格。曾先后就职于招商银行合肥分行、浦发银行金融市场部、华夏基金机构债券投资部,历任产品经理、交易员、投资经理。2017年7月加入南方基金;2018年2月至今,任南方和元、南方祥元、南方荣年基金经理;2018年4月至今,任南方浙利、南方乾利基金经理;2019年1月至今,任南方畅利基金经理;2019年3月至今,任南方平元基金经理;2019年6月至今,任南方初元中短债基金经理。 |
| 金凌志 | 本基金基金经理(已离任) | 2018年3月9日 | 2019年6月24日 | 11年 | 中央财经大学经济学硕士,具有基金从业资格。曾先后就职于中国出口信用保险公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、长盛基金、嘉实基金,历任项目经理、信用分析师、基金经理助理,投资经理。2017年6月加入南方基金;2018年2月至2018年12月,任南方和利基金经理;2018年3月至2019年6月,任南方乾利、南方浙利基金经理;2017年7月至今,任南方稳元、南方荣知、南方纯元基金经理;2018年1月至今,任南方卓利基金经理;2019年3月至今,任南方惠利基金经理。 |

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

上半年经济继续回落,1-6月工业增加值累计同比增长6.0%;1-6月固定资产投资累计同比增长5.8%;1-6月社会消费品零售总额累计同比增长8.4%。通胀方面,6月末CPI同比增速回升至2.7%,PPI回落至0%。金融数据方面,6月末M2同比增长8.5%,上半年信贷投放力度较大,非标收缩的趋势也明显好转,社融增速出现触底回升。

美联储上半年按兵不动,但在6月议息会议后的声明中表示,美国经济前景的不确定性增加,通胀长期低于目标。国内方面,央行上半年分别在1月和5月进行了一次全面降准和定向降准,货币政策整体保持了稳健中性的态度。上半年美元指数上涨0.12%,人民币对美元汇率中间价贬值115个基点。

市场层面,上半年利率债收益率震荡为主,利率曲线变动不大。信用债方面,信用债整体表现好于同期限国开债。

投资运作上,组合以投资中短期限利率债和同业存单为主,杠杆部分积极参与长端利率债操作增厚组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0335元,报告期内,份额净值增长率为1.79%,同期业绩基准增长率为0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,预计经济仍处于探底的阶段,外部需求减弱,叠加内部刺激政策有限,经济回升的动力较弱,需要依赖信贷和财政的发力对冲经济下行风险。通胀方面,目前GDP平减指数相对稳定,通胀和通缩的风险都不大。政策方面,全球货币政策下半年将重新进入宽松的通道中,国内考虑到刚兑打破后的信用收缩风险,以及海外货币政策对国内的约束减小,预计货币政策仍将以防风险和稳经济为主,短期内资金面趋紧的风险较小。利率债方面,考虑到当前内外部经济形势均存在较大的不确定性,流动性风险也依然没有完全消除,货币政策或继续维持较为宽松的状态,无风险利率上行的风险较低。信用债方面,包商银行事件影响颇为深远,信用修复的难度较大,下半年需要谨慎对待低资质信用债,精细择券严防信用风险。

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,本基金于2019年1月24日进行了收益分配(每10份基金份额派发红利0.4330元)。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

不适用。

## §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浙利定期开放债券型发起式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,南方浙利定期开放债券型发起式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浙利定期开放债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上,不存在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,本基金进行了1次利润分配,实施利润分配的金额为 186,499,959.22元。

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浙利定期开放债券型发起式证券投资基金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复核,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:南方浙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

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 | 1,247,362.46 | 3,115,302.41 |
| 结算备付金 | - | - |
| 存出保证金 | - | 9,315.59 |
| 交易性金融资产 | 4,989,514,000.00 | 4,696,033,000.00 |
| 其中:股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 4,989,514,000.00 | 4,696,033,000.00 |
| 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 | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 84,597,967.41 | 97,842,412.77 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 5,075,359,329.86 | 4,797,000,030.77 |
| 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 | 621,998,667.00 | 236,001,288.00 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 1,094,307.32 | 1,157,472.34 |
| 应付托管费 | 364,769.11 | 385,824.11 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 77,769.02 | 56,097.07 |
| 应交税费 | 28,392.27 | 19,711.24 |
| 应付利息 | 202,335.22 | 365,409.90 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 110,993.61 | 315,000.00 |
| 负债合计 | 623,877,233.56 | 238,300,806.66 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 4,307,158,411.70 | 4,307,158,411.70 |
| 未分配利润 | 144,323,684.61 | 251,540,818.41 |
| 所有者权益合计 | 4,451,482,096.31 | 4,558,699,230.11 |
| 负债和所有者权益总计 | 5,075,359,329.86 | 4,797,000,030.77 |

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0335元,基金份额总额4,307,158,411.70份。

6.2 利润表

会计主体:南方浙利定期开放债券型发起式证券投资基金

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3月9日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 95,331,187.08 | 40,258,582.49 |
| 1.利息收入 | 93,529,993.95 | 29,703,814.84 |
| 其中:存款利息收入 | 36,925.76 | 17,380,744.78 |
| 债券利息收入 | 93,482,939.41 | 11,314,561.63 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 10,128.78 | 1,008,518.43 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | 17,256,789.83 | 3,990,672.92 |
| 其中:股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 17,256,789.83 | 3,990,672.92 |
| 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 | - | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | -15,465,656.73 | 6,487,694.75 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | - | 76,399.98 |
| 减:二、费用 | 16,048,361.63 | 4,403,091.96 |
| 1.管理人报酬 | 6,606,476.14 | 1,786,182.47 |
| 2.托管费 | 2,202,156.69 | 595,617.49 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 50,375.00 | 22,325.00 |
| 5.利息支出 | 7,040,372.03 | 1,807,829.84 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 7,040,372.03 | 1,807,829.84 |
| 6.税金及附加 | 19,394.16 | - |
| 7.其他费用 | 129,593.61 | 130,467.16 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 79,282,825.42 | 35,855,490.53 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | 79,282,825.42 | 35,855,490.53 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方浙利定期开放债券型发起式证券投资基金

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) | 4,307,158,411.70 | 251,540,818.41 | 4,558,699,230.11 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 79,282,825.42 | 79,282,825.42 |
| 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) | - | -186,499,959.22 | -186,499,959.22 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 4,307,158,411.70 | 144,323,684.61 | 4,451,482,096.31 |
| 项目 | 上年度可比期间2018年3月9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) | 1,909,999,527.83 | - | 1,909,999,527.83 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 35,855,490.53 | 35,855,490.53 |
| 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) | 1,909,999,527.83 | 35,855,490.53 | 1,945,855,018.36 |

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 |
| 浙商银行股份有限公司(“浙商银行”) | 基金托管人 |

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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

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

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

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3月9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 | 6,606,476.14 | 1,786,182.47 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 0.00 | 0.00 |

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×0.30%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×0.30%÷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3月9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 | 2,202,156.69 | 595,617.49 |

注:支付基金托管人浙商银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%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×0.10%÷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

单位:人民币元

| 本期2019年1月1日至2019年6月30日 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 浙商银行 | 9,923,520.43 | - | - | - | 200,000,000.00 | 14,411.78 |

单位:人民币元

| 上年度可比期间2018年3月9日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 浙商银行 | - | - | - | - | - | - |

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

份额单位:份

| 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3月9日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2018年03月09日)持有的基金份额 | - | 10,000,527.83 |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,000,527.83 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 0.00 | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:报告期间赎回/卖出总份额 | 0.00 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,000,527.83 | 10,000,527.83 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.23% | 0.52% |

注:基金管理人南方基金投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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

份额单位:份

| 关联方名称 | 本期末2019年6月30日 | | 上年度末2018年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 浙商银行股份有限公司(绍兴) | 2,397,158,883.87 | 55.66% | 2,397,158,883.87 | 55.66% |
| 浙商银行股份有限公司(沈阳) | 1,899,999,000.00 | 44.11% | 1,899,999,000.00 | 44.11% |

注:浙商银行投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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3月9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 |
| 浙商银行 | 1,247,362.46 | 36,873.46 | 13,873,526.18 | 60,216.99 |

注:本基金的银行存款由基金托管人浙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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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621,998,667.00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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 160403 | 16农发03 | 2019年7月3日 | 99.92 | 200,000 | 19,984,000.00 |
| 170207 | 17进出07 | 2019年7月1日 | 101.40 | 200,000 | 20,280,000.00 |
| 180203 | 18国开03 | 2019年7月3日 | 102.60 | 2,900,000 | 297,540,000.00 |
| 180208 | 18国开08 | 2019年7月1日 | 101.76 | 2,000,000 | 203,520,000.00 |
| 180302 | 18进出02 | 2019年7月3日 | 102.62 | 100,000 | 10,262,000.00 |
| 180402 | 18农发02 | 2019年7月1日 | 102.59 | 1,200,000 | 123,108,000.00 |
| 合计 | - | - | - | 6,600,000 | 674,694,000.00 |

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 | - | - |
| | 其中:股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 4,989,514,000.00 | 98.31 |
| | 其中:债券 | 4,989,514,000.00 | 98.31 |
| | 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 | 1,247,362.46 | 0.02 |
| 8 | 其他资产 | 84,597,967.41 | 1.67 |
| 9 | 合计 | 5,075,359,329.86 | 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

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金报告期内无买入股票。

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

本基金报告期内无卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金报告期内无股票投资变动。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 20,108,000.00 | 0.45 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 4,192,134,000.00 | 94.17 |
| | 其中:政策性金融债 | 2,164,468,000.00 | 48.62 |
| 4 | 企业债券 | 152,635,000.00 | 3.43 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | 624,637,000.00 | 14.03 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 4,989,514,000.00 | 112.09 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 180204 | 18国开04 | 5,400,000 | 564,246,000.00 | 12.68 |
| 2 | 180208 | 18国开08 | 3,300,000 | 335,808,000.00 | 7.54 |
| 3 | 180203 | 18国开03 | 2,900,000 | 297,540,000.00 | 6.68 |
| 4 | 190206 | 19国开06 | 2,200,000 | 215,490,000.00 | 4.84 |
| 5 | 1828016 | 18民生银行01 | 2,000,000 | 202,180,000.00 | 4.54 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券除18民生银行01(证券代码1828016)外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2018年11月9日,民生银行公告,民生银行存在涉嫌违法违规行为,中国银行保险监督管理委员会根据相关法律法规对公司进行处罚决定。

对上述证券的投资决策程序的说明:本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是,还应对相关股票的投资决策程序做出说明

根据基金合同规定,本基金的投资范围不包括股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 84,597,967.41 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 84,597,967.41 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## §8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 3 | 1,436,719,470.57 | 4,307,158,411.70 | 100.00% | - | - |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,527.83 | 0.23 | 10,000,000.00 | 0.23 | 自合同生效之日起不少于3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人投东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,527.83 | 0.23 | 10,000,000.00 | 0.23 | - |

## §9 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2018年3月09日)基金份额总额 | 1,909,999,527.83 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,307,158,411.70 |
| 本报告期基金总申购份额 | - |
| 减:报告期基金总赎回份额 | - |
| 本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 4,307,158,411.70 |

## §10 重大事件揭示

10.1 基金份额持