南方荣知定期开放混合型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年07月18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。

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2018年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	南方荣知定期开放混合
基金主代码	004443
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年06月15日
报告期末基金份额总额	46,527,148.61份
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	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,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。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%+中债综合指数收益率×85%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。
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

下属分级基金的基金简称	南方荣知定期开放混合A	南方荣知定期开放混合C
下属分级基金的交易代码	004443	004444
报告期末下属分级基金的份额总额	17,566,883.67份	28,960,264.94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“南方荣知”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年04月01日 - 2018年06月30日)	
	南方荣知定期开放混合A	南方荣知定期开放混合C
1.本期已实现收益	483,557.34	1,075,022.64
2.本期利润	613,551.67	1,073,480.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.0081	0.0049
4.期末基金资产净值	18,380,409.44	30,111,388.94
5.期末基金份额净值	1.0463	1.0397

注:

1.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。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认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。基金净值表现

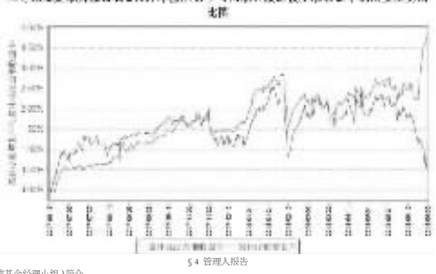
3.1.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方荣知定期开放混合A						
阶段	净值增长率①	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
过去三个月	1.91%	0.14%	-0.66%	0.18%	2.57%	-0.04%

南方荣知定期开放混合C						
阶段	净值增长率①	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
过去三个月	1.75%	0.14%	-0.66%	0.18%	2.41%	-0.04%

注:-

3.1.2 自基金合同生效以来基金累计份额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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
金凌忠	本基金基金经理	2017年7月28日		10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,需求基金,历任项目经理、信用分析师、基金经理助理、投资经理,2017年5月加入南方基金;2017年7月至今,任南方润元、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;2018年2月至今,任南方乾利、南方新利基金经理。
李骏	本基金基金经理	2017年6月15日		10年	女,清华大学金融学硕士,硕士,注册金融分析师(CFA),具有基金从业资格。2007年加入南方基金,担任信用债高级分析师,现任固定收益投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员。2010年9月至2012年6月,任南方宝元基金经理;2012年12月至2014年9月,任南方安心基金经理;2015年12月至2017年2月,任南方润元基金经理;2013年7月至2017年9月,任南方稳利基金经理;2016年8月至2017年12月,任南方通利、南方荣冠基金经理;2016年8月至2018年2月,任南方丰元基金经理;2016年11月至2018年2月,任南方荣安基金经理;2010年9月至今,任南方多利基金经理;2012年5月至今,任南方多元基金经理;2016年9月至今,任南方荣耀基金经理;2017年1月至今,任南方荣尊基金经理;2017年6月至今,任南方荣知基金经理;2017年9月至今,任南方兴利基金经理。

注:1. 对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内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《南方荣知定期开放混合型证券投资基金基金合同》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的情况。

4.3 公平交易专项说明

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。

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均未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度经济有所回落,1-5月工业增加值累计同比增长6.9%,1-5月固定资产投资累计同比增长6.1%,投资数据较一季度显著回落,基建投资下滑是主要拖累项,1-5月社会消费品零售总额累计同比增长9.5%,较一季度继续回落。通胀方面,由于食品价格低迷,4.5月CPI同比增长回落至1.8%,而PPI受到油价上涨和基数较低的影响,4.5月同比增幅回升至3.4%和4.1%。金融数据方面,M2增速依然偏低,4.5月同比增速仅8.3%,信贷较去年同期有一定增长,不过由于非标政缩导致社融整体出现明显下滑。

美联储6月议息会议再次加息25BP,同时上调了今年的经济增速和今明两年的通胀预测,欧央行维持三大利率不变,维持每月购债规模300亿欧元不变。国内央行在二季度两次降准,且二季度美联储加息后央行并未跟随调整,货币政策转向中性偏松。二季度美元指数上涨4.54%,人民币兑美元汇率中间价贬值3285个基点。二季度银行间隔夜、7天回购加权利率均值为2.73%、3.39%,分别较上季度回升5BP和18BP。

市场层面,利率债收益率震荡下行,1年国债、1年国开收益率分别下行16BP、33BP,10年国债、10年国开收益率分别下行27BP、39BP,利率曲线平坦化下移,信用债表现弱于同期限国开债,中票表现好于城投,AAA表现好于AA,二季度权益市场大跌,上证综指下跌10.14%,沪深300、中小板指和创业板指全线下挫,跌幅分别为9.94%、12.97%和15.46%。正股的不佳表现也带动了转债市场的下跌,二季度中证转债指数跌幅5.82%。投资运作上,债券方面,因资金面相对宽松,融资成本较低,组合在维持中性略偏长的久期下,积极合理增加杠杆,增持短期限债券,获取票息收益和一定资本利得。股票方面,二季度A股在贸易摩擦和金融去杠杆内外双重因素作用下持续下跌,组合在该过程中减仓至中性偏低水平。预计下半年经济将弱于上半年,基本面下行的压力仍未缓解。随着去杠杆带来的基本面风险提升,叠加外部局势的不稳定,货币政策已经出现了转向,但货币新规细则仍未落地,债券市场配置力量依然偏弱,且主要集中在高等级和中短端。利率债方面,短期行情或有反复,中长期看,利率下行的基础依然存在,需要等待短端的进一步下行打开长端下行的空间。信用债方面,融资环境的收紧和资管新规的落地对低等级信用债造成了较大冲击,信用利差走扩的压力较大,下半年需密切关注民企、城投平台等在本轮紧信用环境中受冲击最明显的领域,加强对持仓债券的跟踪和梳理,严防信用风险。权益市场方面,股市和转债估值均处于历史底部区域,目下而上挖掘业绩有支撑、估值更便宜的公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A级净值增长率为1.91%,业绩比较基准收益率为-0.66%;C级净值增长率为1.75%,业绩比较基准收益率为-0.66%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	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	60,836,112.25	94.41
	其中:债券	60,836,112.25	94.41
	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	1,755,108.44	2.72
8	其他资产	1,843,636.94	2.86
9	合计	64,434,857.63	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	-	-
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	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

5.2.2 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。

5.3 报告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	600887	伊利股份	67,400	1,880,460.00	1.85
2	600085	同仁堂	10,600	373,968.00	0.37
3	600867	通化东宝	80	1,917.60	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	25,238,500.00	24.79
	其中:政策性金融债	20,244,000.00	19.89
4	企业债券	75,186,506.01	73.86
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,650,000.00	19.30
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	120,075,006.01	117.96

5.5 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债券投资明细

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	100,000	10,251,000.00	10.07
2	122284	13鲁企02	100,000	10,078,000.00	9.90
3	180207	18国开07	100,000	9,993,000.00	9.82
4	101800588	18天士力医MTN001	100,000	9,938,000.00	9.76
5	101678004	16百别MTN001	100,000	9,712,000.00	9.54

5.6 报告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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146129	花园27A1	85,000	8,499,150.00	8.35

5.7 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	16,888.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,790,508.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,807,396.90

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注:无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	99,314,996.28
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	99,314,996.28

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.南方荣毅定期开放混合型证券投资基金基金合同

2.南方荣毅定期开放混合型证券投资基金托管协议

3.南方荣毅定期开放混合型证券投资基金2018年2季度报告原文

9.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层。

9.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com

南方荣毅定期开放混合型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2018年07月18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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期为2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	南方荣毅定期开放混合
基金主代码	002931
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年08月03日
报告期末基金份额总额	99,314,996.28份
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	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,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。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×10%+中债综合指数收益率×90%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

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“南方荣毅”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年04月01日 - 2018年06月30日)
1.本期已实现收益	41,402.74
2.本期利润	22,725.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0002
4.期末基金资产净值	101,793,674.63
5.期末基金份额净值	1.025

注:1.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;

2.所述基金业绩指标不包括持有人认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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	0.00%	0.15%	-0.11%	0.14%	0.11%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑迎迎	本基金基金经理	2017年9月7日		10年	女,中国人民大学金融学硕士,具有基金从业资格。曾先后就职于农银汇理基金、富国基金,历任行业研究员、信用研究员、基金经理;2012年10月至2015年1月,任富国产业发展混合基金经理;2013年1月至2015年4月,任富国强回报基金经理;2014年3月至2016年10月,任富国可转换债券基金经理;2015年4月至2017年3月,任富国新天锋、富国收益增强基金经理;2015年8月至2016年9月,任富国新动力基金经理;2016年1月至2017年3月,任富国稳健增强基金经理;2017年6月加入南方基金;2017年8月至今,任南方高元、南方荣光、南方通利基金经理;2017年9月至今,任南方荣毅基金经理;2017年10月至今,任南方多利基金经理;2017年12月至今,任南方荣冠基金经理;2018年2月至今,任南方卓元基金经理。

注:1. 对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内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《南方荣毅定期开放混合型证券投资基金基金合同》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的情况。

4.3 公平交易专项说明

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。

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均未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度经济有所回落,1-5月工业增加值累计同比增长6.9%,1-5月固定资产投资累计同比增长6.1%,投资数据较一季度显著回落,基建投资下滑是主要拖累项,1-5月社会消费品零售总额累计同比增长9.5%,较一季度继续回落。通胀方面,由于食品价格低迷,4.5月CPI同比增长回落至1.8%,而PPI受到油价上涨和基数较低的影响,4.5月同比增幅回升至3.4%和4.1%。金融数据方面,M2增速依然偏低,4.5月同比增速仅8.3%,信贷较去年同期有一定增长,不过由于非标政缩导致社融整体出现明显下滑。

美联储6月议息会议再次加息25BP,同时上调了今年的经济增速和今明两年的通胀预测,欧央行维持三大利率不变,维持每月购债规模300亿欧元不变。国内央行在二季度两次降准,且二季度美联储加息后央行并未跟随调整,货币政策转向中性偏松。二季度美元指数上涨4.54%,人民币兑美元汇率中间价贬值3285个基点。二季度银行间隔夜、7天回购加权利率均值为2.73%、3.39%,分别较上季度回升5BP和18BP。

市场层面,利率债收益率震荡下行,1年国债、1年国开收益率分别下行16BP、33BP,10年国债、10年国开收益率分别下行27BP、39BP,利率曲线平坦化下移,信用债表现弱于同期限国开债,中票表现好于城投,AAA表现好于AA,二季度权益市场大跌,上证综指下跌10.14%,沪深300、中小板指和创业板指全线下挫,跌幅分别为9.94%、12.97%和15.46%。正股的不佳表现也带动了转债市场的下跌,二季度中证转债指数跌幅5.82%。

投资运作上,组合以短端信用债配置为主,同时由于6月底资金面相对紧张,资金利率较高,因此将一部分仓位用于放逆回购,整体来说为组合创造了稳定的收益,权益方面,组合仓位很低,避免了大幅的回撤。

预计下半年经济将弱于上半年,基本面下行的压力仍未缓解。随着去杠杆带来的基本面风险提升,叠加外部局势的不稳定,货币政策已经出现了转向,但货币新规细则仍未落地,债券市场配置力量依然偏弱,且主要集中在高等级和中短端。利率债方面,短期行情或有反复,中长期看,利率下行的基础依然存在,需要等待短端的进一步下行打开长端下行的空间。信用债方面,融资环境的收紧和资管新规的落地对低等级信用债造成了较大冲击,信用利差走扩的压力较大,下半年需密切关注民企、城投平台等在本轮紧信用环境中受冲击最明显的领域,加强对持仓债券的跟踪和梳理,严防信用风险。权益市场方面,股市和转债估值均处于历史底部区域,目下而上挖掘业绩有支撑、估值更便宜的公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内A级基金净值增长率为0.00%,同期业绩比较基准增长率为-0.66%;C级基金净值增长率为-0.09%,同期业绩比较基准增长率为-0.66%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期,2018年4月25日至2018年6月30日,已出现连续45个工作日基金资产净值低于五千万人民币的情形。

2016年4月1日至2018年6月30日,已出现连续60个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本基金已依照相关法律法规及基金合同的要求向中国证监会备案清盘,并着手办理基金份额持有人大会表决等后续事宜。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,256,345.60	1.64
	其中:股票	2,256,345.60	1.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	128,574,156.01	93.42
	其中:债券	120,075,006.01	87.24
	资产支持证券	8,499,150.00	6.18
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	3,991,971.44	2.90
8	其他资产	2,807,396.90	2.04
9	合计	137,629,869.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	2,256,345.60	2.22
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	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,256,345.60	2.22

5.2.2 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股票。

5.3 报告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	600887	伊利股份	67,400	1,880,460.00	1.85
2	600085	同仁堂	10,600	373,968.00	0.37
3	600867	通化东宝	80	1,917.60	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	25,238,500.00	24.79
	其中:政策性金融债	20,244,000.00	19.89
4	企业债券	75,186,506.01	73.86
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,650,000.00	19.30
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	120,075,006.01	117.96

5.5 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债券投资明细

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	100,000	10,251,000.00	10.07
2	122284	13鲁企02	100,000	10,078,000.00	9.90
3	180207	18国开07	100,000	9,993,000.00	9.82
4	101800588	18天士力医MTN001	100,000	9,938,000.00	9.76
5	101678004	16百别MTN001	100,000	9,712,000.00	9.54

5.6 报告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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146129	花园27A1	85,000	8,499,150.00	8.35

5.7 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

5.11.2 声明其余股票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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	89,085.90
2	应收证券清算款	1,571.80
3	应收股利	-
4	应收利息	268,726.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	359,384.12

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000415	渤海金控	1,173,120.00	4.57	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	南方荣毅A	南方荣毅C
报告期期初基金份额总额	740,132,838.80	119,005.85
报告期期间基金总申购份额	4,250.88	-
减:报告期期间基金总赎回份额	716,540,930.54	22,001.05
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	23,596,159.14	97,004.80

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比(%)
机构	1	20180401-20180630	740,038,055.55	-	716,500,000.00		23,538,055.55	99.35
个人	-	-	-	-	-		-	-
产品特有风险								
本基金存在持有基金份额超过20%的基金份额持有人,在特定赎回比例及市场条件下,若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产,将会导致流动性风险和基金净值波动风险。								

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.《南方荣毅定期开放混合型证券投资基金基金合同》。

2.《南方荣毅定期开放混合型证券投资基金托管协议》。

3.南方荣毅定期开放混合型证券投资基金2018年2季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层。

9.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com

南方荣优鑫年享定期开放混合型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2018年07月18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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	南方荣优鑫年享定期开放混合
基金主代码	003807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年03月24日
报告期末基金份额总额	23,693,163.94份
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	1.资产配置策略 本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评