

南方安裕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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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,基金的投资业绩并不表示其未来表现,投资者有风险,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。
本报告财务资料未经审计。
本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

基金名称	南方安裕混合
基金代码	002020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2016年12月16日
报告期末基金份额总额	713,983,926.90
投资策略	本基金为主动管理型证券投资基金,属股票型基金,通过精选个股和组合,通过定向增发、资产重组等方式,力求实现基金资产的长期增值,并适度参与二级市场股票投资。
业绩比较基准	本基金的投资目标为力争实现基金净值增长率超越沪深300指数,并力争实现基金净值增长率超越沪深300指数。
风险收益特征	本基金为主动管理型证券投资基金,属股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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

注:1.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“南方安裕混合”。
2.2018年5月23日起,本基金的基金名称变更为“南方安裕混合型证券投资基金”。

3 主要财务指标

本报告期末	本报告期末比上年末增减	本报告期末比上年末增减率
1.本期已实现收益	9,844,530.90	-1067.84%
2.本期公允价值变动收益	-407,986.89	-10.00%
3.本期基金净值增长	713,983,926.90	1.00%

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

期间	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率-业绩比较基准收益率
本报告期	-0.24%	0.27%	-0.51%
今年以来	-0.24%	0.27%	-0.51%
自基金合同生效以来	-0.24%	0.27%	-0.51%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职日期	证券从业年限	说明
张海波	基金经理	2016年12月16日	10年	曾任大成基金研究员,2010年加入南方基金,历任研究员、基金经理助理,2012年12月担任南方基金基金经理,2013年12月担任南方基金基金经理,2014年12月担任南方基金基金经理,2015年12月担任南方基金基金经理,2016年12月担任南方基金基金经理,2017年12月担任南方基金基金经理,2018年12月担任南方基金基金经理。

注:1.对基金的聘任基金经理,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;对此后的首次聘任基金经理,其“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.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
3.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
4.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
5.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
6.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
7.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
8.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
9.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
10.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	457,021,744.98	64.16%
2	固定收益投资	170,700,744.98	23.91%
3	货币资金	76,661,428.26	10.73%
4	其他资产	76,661,428.26	10.73%
5	负债	-	-
6	净资产	713,983,926.90	100.00%

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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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,基金的投资业绩并不表示其未来表现,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。
本报告财务资料未经审计。
本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

基金名称	南方安颐混合
基金代码	002021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2016年12月16日
报告期末基金份额总额	713,983,926.90
投资策略	本基金为主动管理型证券投资基金,属股票型基金,通过精选个股和组合,通过定向增发、资产重组等方式,力求实现基金资产的长期增值,并适度参与二级市场股票投资。
业绩比较基准	本基金的投资目标为力争实现基金净值增长率超越沪深300指数,并力争实现基金净值增长率超越沪深300指数。
风险收益特征	本基金为主动管理型证券投资基金,属股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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

注:1.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“南方安颐混合”。
2.2018年5月23日起,本基金的基金名称变更为“南方安颐混合型证券投资基金”。

3 主要财务指标

本报告期末	本报告期末比上年末增减	本报告期末比上年末增减率
1.本期已实现收益	-106,784.53	-10.00%
2.本期公允价值变动收益	-407,986.89	-10.00%
3.本期基金净值增长	713,983,926.90	1.00%

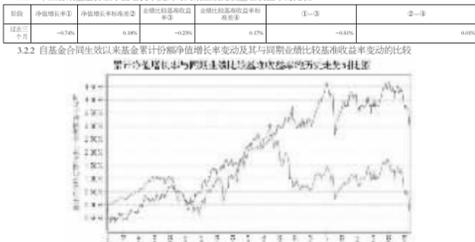
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

期间	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率-业绩比较基准收益率
本报告期	-0.24%	0.27%	-0.51%
今年以来	-0.24%	0.27%	-0.51%
自基金合同生效以来	-0.24%	0.27%	-0.51%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职日期	证券从业年限	说明
张海波	基金经理	2016年12月16日	10年	曾任大成基金研究员,2010年加入南方基金,历任研究员、基金经理助理,2012年12月担任南方基金基金经理,2013年12月担任南方基金基金经理,2014年12月担任南方基金基金经理,2015年12月担任南方基金基金经理,2016年12月担任南方基金基金经理,2017年12月担任南方基金基金经理,2018年12月担任南方基金基金经理。

注:1.对基金的聘任基金经理,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;对此后的首次聘任基金经理,其“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.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
3.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
4.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
5.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
6.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
7.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
8.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
9.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
10.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。

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	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药生物	-	-
B	信息技术	18,023,613.18	2.54%
C	制造业	17,044,200.00	2.39%
D	采掘业、有色金属及新材料	17,044,200.00	2.39%
E	房地产业	17,044,200.00	2.39%
F	交通运输、仓储业	17,044,200.00	2.39%
G	公用事业	17,044,200.00	2.39%
H	金融业	17,044,200.00	2.39%
I	其他	17,044,200.00	2.39%

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股投资股票。

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	000001	平安银行	9,800,000	15,880,000.00	2.22%
2	000002	万科A	12,000,000	15,840,000.00	2.21%
3	000011	华能国际	10,000,000	15,800,000.00	2.20%
4	000012	招商银行	8,000,000	15,760,000.00	2.19%
5	000033	美的集团	6,000,000	15,720,000.00	2.18%
6	000036	招商银行	5,000,000	15,680,000.00	2.17%
7	000039	浦发银行	4,000,000	15,640,000.00	2.16%
8	000041	深发展A	3,000,000	15,600,000.00	2.15%
9	000056	中航资本	2,000,000	15,560,000.00	2.14%
10	000060	中金公司	1,000,000	15,520,000.00	2.13%

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170001	17国债01	70,000,000	70,000,000.00	9.80%
2	170002	17国债02	70,000,000	70,000,000.00	9.80%
3	170003	17国债03	70,000,000	70,000,000.00	9.80%
4	170004	17国债04	70,000,000	70,000,000.00	9.80%
5	170005	17国债05	70,000,000	70,000,000.00	9.80%

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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:本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 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

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在发行主体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。

5.12 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

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在超出基金合同规定的备选股票库。

5.13 其他资产构成

序号	项目	金额(人民币元)
1	应收利息	16,712.51
2	应收股利	2,000,000.00
3	其他应收款	10,000,000.00
4	其他资产	10,000,000.00
5	合计	12,026,712.51

5.14 报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120804	12国债04	100,000	100,000.00	0.01%
2	120805	12国债05	100,000	100,000.00	0.01%
3	120806	12国债06	100,000	100,000.00	0.01%
4	120807	12国债07	100,000	100,000.00	0.01%
5	120808	12国债08	100,000	100,000.00	0.01%

5.15 报告期末前十名股票中存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存在流通受限情况。

5.6 开放式基金资产净值

报告期末基金份额总额	单位:份
713,983,926.90	

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:基金管理人持有本基金份额变动情况。
注:基金管理人持有本基金份额。
注:基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细。
注:本基金报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

5.8 备查文件目录

- 1.《南方安裕混合型证券投资基金合同》
- 2.《南方安裕混合型证券投资基金托管协议》
- 3.南方安裕混合型证券投资基金2018年2季度报告原文
- 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。
- 3 查阅方式: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。

网站:http://www.nffund.com

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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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,基金的投资业绩并不表示其未来表现,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。
本报告财务资料未经审计。
本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

基金名称	南方宝元债券
基金代码	002044
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2016年12月16日
报告期末基金份额总额	1,000,000,000.00
投资策略	本基金为主动管理型债券基金,以国债、金融债、企业债、可转债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、货币市场工具等为主要投资对象,通过精选个券和组合,力求实现基金资产的长期增值,并适度参与二级市场股票投资。
业绩比较基准	本基金的投资目标为力争实现基金净值增长率超越沪深300指数,并力争实现基金净值增长率超越沪深300指数。
风险收益特征	本基金为主动管理型债券基金,其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、股票型基金及货币市场基金。
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

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“南方宝元”。

3 1 主要财务指标

本报告期末	本报告期末比上年末增减	本报告期末比上年末增减率
1.本期已实现收益	-106,784.53	-10.00%
2.本期公允价值变动收益	-407,986.89	-10.00%
3.本期基金净值增长	1,000,000,000.00	1.00%

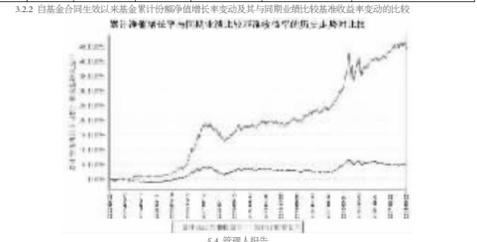
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

期间	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率-业绩比较基准收益率
本报告期	-0.24%	0.27%	-0.51%
今年以来	-0.24%	0.27%	-0.51%
自基金合同生效以来	-0.24%	0.27%	-0.51%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职日期	证券从业年限	说明
张海波	基金经理	2016年12月16日	10年	曾任大成基金研究员,2010年加入南方基金,历任研究员、基金经理助理,2012年12月担任南方基金基金经理,2013年12月担任南方基金基金经理,2014年12月担任南方基金基金经理,2015年12月担任南方基金基金经理,2016年12月担任南方基金基金经理,2017年12月担任南方基金基金经理,2018年12月担任南方基金基金经理。

注:1.对基金的聘任基金经理,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;对此后的首次聘任基金经理,其“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.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
3.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
4.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
5.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
6.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
7.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
8.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
9.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。
10.基金经理的从业年限以证监会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。

5 1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:基金管理人持有本基金份额变动情况。
注:基金管理人持有本基金份额。
注:基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细。
注:本基金报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

5.8 备查文件目录

- 1.《南方安裕混合型证券投资基金合同》
- 2.《南方安裕混合型证券投资基金托管协议》
- 3.南方安裕混合型证券投资基金2018年2季度报告原文
- 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。
- 3 查阅方式: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。

网站:http://www.nffund.com

南方安颐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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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,基金的投资业绩并不表示其未来表现,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。
本报告财务资料未经审计。
本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

基金名称	南方安颐混合
基金代码	002021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2016年12月16日
报告期末基金份额总额	713,983,926.90
投资策略	本基金为主动管理型证券投资基金,属股票型基金,通过精选个股和组合,通过定向增发、资产重组等方式,力求实现基金资产的长期增值,并适度参与二级市场股票投资。
业绩比较基准	本基金的投资目标为力争实现基金净值增长率超越沪深300指数,并力争实现基金净值增长率超越沪深300指数。
风险收益特征	本基金为主动管理型证券投资基金,属股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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

注:1.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“南方安颐混合”。
2.2018年5月23日起,本基金的基金名称变更为“南方安颐混合型证券投资基金”。

3 主要财务指标

本报告期末	本报告期末比上年末增减	本报告期末比上年末增减率
1.本期已实现收益	-106,784.53	-10.00%
2.本期公允价值变动收益	-407,986.89	-10.00%
3.本期基金净值增长	713,983,926.90	1.00%