南方薪金宝货币市场基金

2019 第二季度 报告

2019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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月16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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月12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。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方薪金宝货币
基金主代码	000687
交易代码	000687
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月23日
报告期末基金份额总额	11,600,959,980.69份
投资目标	在控制投资组合风险,保持流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

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“南方薪金宝”。

§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(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	83,337,498.95
2.本期利润	83,337,498.95
3.期末基金资产净值	11,600,959,980.69

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,所以,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

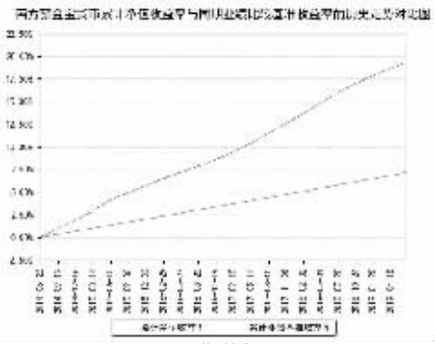
3.2 基金净值表现

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	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6415%	0.0003%	0.3418%	0.0000%	0.2997%	0.0003%

注:本基金收益分配为按日结转份额。

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		
蔡奕奕	本基金基金经理	2016年8月26日	-	13年	女,中南大学管理科学与工程专业硕士,具有基金从业资格,曾先后就职于万家基金、银河基金、融通基金,历任交易员、研究员、基金经理助理;2011年10月至2015年3月,任融通易支付货币基金经理;2012年3月至2015年3月,任融通四季添利债券基金经理;2012年11月至2015年3月,任融通岁岁添利债券基金经理;2014年8月至2015年3月,任融通月月添利定开债券基金经理,2015年4月加入南方基金;2016年8月至2019年5月,任南方日添益基金经理;2016年8月至今,任南方薪金宝、南方鑫财富基金经理;2016年11月至今,任南方天天利基金经理;2017年8月至今,任南方收益宝基金经理;2019年3月至今,任南方天天宝基金经理。

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 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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4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 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济数据显示经济仍面临较大的下行压力,5月PMI为49.4%,比上月回落0.7%,位于荣枯线以下,制造业景气持续转弱,5月固定资产投资累计同比5.6%,比上月回落0.5%,低于市场预期,民间投资增速进一步回落至5.3%,经济内生增长动能不足。房地产开发投资增速继续维持高位,累计同比11.2%,主要是项目施工带来的建筑工程加速上行,但后续土地购置费断崖式下行或将形成拖累。制造业投资增速小幅回升,累计同比2.7%,但企业盈利和融资环境仍然没有得到明显改善,反弹力度将持续性有限。基建投资增速有所下滑,累计同比4%,专项债作为项目资本金落地后的效果预计也很有限。5月PPI同比上涨0.6%,CPI同比上涨2.7%。6月20日,美联储公布6月FOMC议息会议决议,表示鉴于经济增长及通胀前景不确定性上升,去除此前“保持耐心”偏中性的措辞,改为更具降息倾向的“将采取合适行动以保持经济扩张”,降息的概率大幅增加。

二季度A股指数震荡调整,上证综指下跌3.62%,沪深300下跌1.21%,上证50上涨3.24%,创业板指下跌10.75%,中小板指下跌10.99%。在所有行业指数中,食品饮料、家电、银行、餐饮旅游、非银金融等行业涨幅排名靠前。

展望三季度,国内宏观经济面临较大的下行压力,国内制造业景气水平维持低位,投资内生动力不足。近期中美又重新开始贸易谈判,但预计中美贸易摩擦是一个长期的过程。国内政策上对民营企业扶持帮助,国内各方面的应对措施也会根据经济的实际情况逐步推出。金融供给侧改革政策暖风频吹,科创板正有序推进,A股整体有望震荡向上。

报告期内,我们对市场维持中性偏乐观的判断,资产配置上保持了中性偏高的股票仓位。科创板7月推出将提升市场对科技股的重视程度,也将重构科技股的估值体系。我们重点布局了计算机、通信、电子等成长股行业,同时配置了高端制造、新零售等与互联网技术深度融合的方向。

4.5 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0.972元,报告期内,份额净值增长率为-2.41%,同期业绩基准增长率为-0.26%。

4.6 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 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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	9,236,197,654.22	74.39
	其中:债券	9,236,197,654.22	74.39
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	500,226,350.35	4.03
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,363,347,507.48	19.04
4	其他资产	315,987,745.76	2.55
5	合计	12,415,759,257.81	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	6.37
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	807,521,295.73	6.96
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

5.2.1 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	100
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	110
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	62

5.3.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.3 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	30.69	6.96
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	15.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	12.55	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	7.11	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	40.81	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.63	6.96

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	90,070,899.56	0.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	769,568,679.94	6.63
	其中:政策性金融债	769,568,679.94	6.63
4	企业债券	40,409,489.16	0.35
5	企业短期融资券	1,934,629,660.02	16.68
6	中期票据	-	-
7	同业存单	6,401,518,925.54	55.18
8	其他	-	-
9	合计	9,236,197,654.22	79.62
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111922012	19邮储银行CD012	4,000,000	399,372,716.92	3.44
2	111811300	18平安银行CD300	4,000,000	399,066,765.08	3.44
3	111909175	19浦发银行CD175	4,000,000	397,623,505.28	3.43
4	011901188	19中电投SCP018	3,000,000	299,637,075.22	2.58
5	190206	19国开06	3,000,000	299,610,201.47	2.58
6	111916167	19上海银行CD167	3,000,000	299,509,169.66	2.58
7	111981192	19郑州银行CD119	3,000,000	299,488,662.81	2.58
8	111911058	19平安银行CD058	3,000,000	299,070,465.37	2.58
9	111999677	19河北银行CD046	2,600,000	256,327,612.63	2.21
10	190302	19进出02	2,500,000	249,893,379.48	2.15

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0813%
报告期内偏离度的最低值	-0.0011%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0347%

5.7.1 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本基金无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

5.7.2 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本基金无正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用“摊余成本法”计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益。

5.9.2 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平安银行CD300(证券代码111811300)、19平安银行CD058(证券代码111911058)、19浦发银行CD175(证券代码111909175)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。

1.18平安银行CD300(证券代码111811300)

2018年7月10日,平安银行公告,因存在违法违规行为,中国银行业监督管理委员会天津监管局根据《中国银监会关于印发〈节能减排授信工作指导意见〉的通知》、《中国银监会关于印发绿色信贷指引的通知》、《流动资金贷款管理暂行办法》、《中华人民共和国银行业监督管理法》对公司进行处罚,罚款人民币50万元。

2.19平安银行CD058(证券代码111911058)

2018年7月10日,平安银行公告,因存在违法违规行为,中国银行业监督管理委员会天津监管局根据《中国银监会关于印发〈节能减排授信工作指导意见〉的通知》、《中国银监会关于印发绿色信贷指引的通知》、《流动资金贷款管理暂行办法》、《中华人民共和国银行业监督管理法》对公司进行处罚,罚款人民币50万元。

3.19浦发银行CD175(证券代码111909175)

2018年12月28日浦发银行公告,因存在违法违规行为,中国银行保险监督管理委员会无锡监管分局根据相关法律法规对公司进行处罚。2018年9月30日浦发银行公告,因存在违法违规行为,中国银行业监督管理委员会盐城监管分局根据《中华人民共和国银行业监督管理法》对公司进行处罚,罚款人民币25万元。2018年8月31日浦发银行公告,因存在违法违规行为,中国银行业监督管理委员会温州监管分局根据相关法律法规对公司进行处罚。

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。

5.9.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	42,871.72
2	应收证券清算款	270,866,856.39
3	应收利息	45,073,017.65
4	应收申购款	-
5	其他应收款	5,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	315,987,745.76

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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	14,566,985,341.38
报告期期间基金总申购份额	10,751,466,481.24
报告期期间基金总赎回份额	13,717,491,841.93
报告期期末基金份额总额	11,600,959,980.69

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	分红	2019年4月1日	2.08	2.08	0.00%
2	分红	2019年4月2日	0.64	0.64	0.00%
3	分红	2019年4月3日	0.66	0.66	0.00%
4	分红	2019年4月4日	0.66	0.66	0.00%
5	分红	2019年4月8日	2.71	2.71	0.00%
6	分红	2019年4月9日	0.66	0.66	0.00%
7	分红	2019年4月10日	0.68	0.68	0.00%
8	分红	2019年4月11日	0.65	0.65	0.00%
9	分红	2019年4月12日	0.64	0.64	0.00%
10	分红	2019年4月15日	1.95	1.95	0.00%
11	分红	2019年4月16日	0.65	0.65	0.00%
12	分红	2019年4月17日	0.65	0.65	0.00%
13	分红	2019年4月18日	0.63	0.63	0.00%
14	分红	2019年4月19日	0.65	0.65	0.00%
15	分红	2019年4月22日	1.91	1.91	0.00%
16	分红	2019年4月23日	0.64	0.64	0.00%
17	分红	2019年4月24日	0.63	0.63	0.00%
18	分红	2019年4月25日	0.65	0.65	0.00%
19	分红	2019年4月26日	0.63	0.63	0.00%
20	分红	2019年4月29日	1.93	1.93	0.00%
21	分红	2019年4月30日	0.65	0.65	0.00%
22	分红	2019年5月6日	3.82	3.82	0.00%
23	分红	2019年5月7日	0.65	0.65	0.00%
24	分红	2019年5月8日	0.66	0.66	0.00%
25	分红	2019年5月9日	0.67	0.67	0.00%
26	分红	2019年5月10日	0.67	0.67	0.00%
27	分红	2019年5月13日	2.04	2.04	0.00%
28	分红	2019年5月14日	0.66	0.66	0.00%
29	分红	2019年5月15日	0.65	0.65	0.00%
30	分红	2019年5月16日	0.65	0.65	0.00%
31	分红	2019年5月17日	0.65	0.65	0.00%
32	分红	2019年5月20日	1.88	1.88	0.00%
33	分红	2019年5月21日	0.64	0.64	0.00%
34	分红	2019年5月22日	0.64	0.64	0.00%
35	分红	2019年5月23日	0.71	0.71	0.00%
36	分红	2019年5月24日	0.64	0.64	0.00%
37	分红	2019年5月27日	1.95	1.95	0.00%
38	分红	2019年5月28日	0.64	0.64	0.00%
39	分红	2019年5月29日	0.64	0.64	0.00%
40	分红	2019年5月30日	0.65	0.65	0.00%
41	分红	2019年5月31日	0.65	0.65	0.00%
42	分红	2019年6月3日	1.95	1.95	0.00%
43	分红	2019年6月4日	0.65	0.65	0.00%
44	分红	2019年6月5日	0.66	0.66	0.00%
45	分红	2019年6月6日	0.65	0.65	0.00%
46	分红	2019年6月10日	2.63	2.63	0.00%
47	分红	2019年6月11日	0.66	0.66	0.00%
48	分红	2019年6月12日	0.65	0.65	0.00%
49	分红	2019年6月13日	0.65	0.65	0.00%
50	分红	2019年6月14日	0.79	0.79	0.00%
51	分红	2019年6月17日	1.99	1.99	0.00%
52	分红	2019年6月18日	0.65	0.65	0.00%
53	分红	2019年6月19日	0.66	0.66	0.00%
54	分红	2019年6月20日	0.65	0.65	0.00%
55	分红	2019年6月21日	0.62	0.62	0.00%
56	分红	2019年6月24日	1.80	1.80	0.00%
57	分红	2019年6月25日	0.62	0.62	0.00%
58	分红	2019年6月26日	0.58	0.58	0.00%
59	分红	2019年6月27日	0.68	0.68	0.00%
60	分红	2019年6月28日	0.62	0.62	0.00%
合计	-	-	59.27	59.27	-

基金管理人按照本基金合同约定费率进行认购、申购和赎回。

§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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《南方薪金宝货币市场基金基金合同》;

2、《南方薪金宝货币市场基金托管协议》;

3、南方薪金宝货币市场基金2019年2季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦32-42楼。

9.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com

南方利达灵活配置混合型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019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:北京银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月16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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月12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。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方利达灵活配置混合
基金主代码	001566
交易代码	001566
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月8日
报告期末基金份额总额	379,853,176.47份
投资目标	在有效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及投资,力争实现基金资产的长期稳健增值。
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,本基金将积极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	本基金的业绩比较基准为:人民币三年期定期存款利率(税后)×2%
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	北京银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	南方利达A	南方利达C
下属分级基金的交易代码	001566	001567
报告期末下属分级基金的份额总额	254,391,717.24份	125,461,459.23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“南方利达”。

§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(2019年4月1日-2019年6月30日)	
	南方利达A	南方利达C
1.本期已实现收益	1,592,726.36	409,867.62
2.本期利润	1,826,254.78	407,428.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0100	0.0082
4.期末基金资产净值	304,221,551.86	150,012,554.53
5.期末基金份额净值	1.196	1.196

注:1.上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;

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。

3.2 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

南方利达A

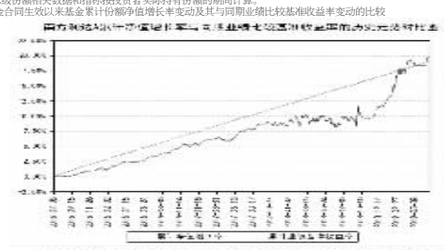
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.70%	0.17%	1.00%	0.01%	0.70%	0.16%

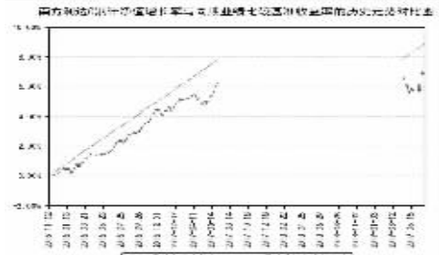
南方利达C

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	0.42%	0.15%	0.98%	0.01%	-0.56%	0.14%

注:本基金C级份额相关数据和指标按投资者实际持有份额的期间计算。

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





注:1.本基金从2015年11月12日起新增C类份额,C类份额自2015年11月12日起存续。

2.本基金C级份额相关数据和指标按投资者实际持有份额的期间计算。

§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		
吴剑毅	本基金基金经理	2015年7月8日	-	10年	清华大学金融学硕士,具有基金从业资格。2009年7月加入南方基金,任南方基金研究部金融行业研究员;2012年3月至2014年7月,担任南方鼎锐,南方保本基金经理助理;2015年11月至2017年12月,任南方顺康保本基金经理;2014年7月至2018年1月,任南方恒元基金经理;2015年9月至2018年11月,任南方消费活力基金经理;2015年10月至2018年11月,任南方顺达保本基金经理;2017年8月至2019年1月,任南方金融混合基金经理;2015年5月至今,任南方利众基金经理;2015年7月至今,任南方利达基金经理;2015年11月至今,任南方利安基金经理。2016年12月至今,任南方安顺混合基金经理;2017年11月至今,任南方安福混合基金经理;2017年12月至今,任南方顺康混合基金经理;2018年2月至今,任南方安泰混合基金经理;2018年11月至今,任南方中小盘成长股票基金经理;2019年1月至今,任南方新蓝筹混合基金经理。

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 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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4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 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济数据显示经济仍面临较大的下行压力,5月PMI为49.4%,比上月回落0.7%,位于荣枯线以下,制造业景气持续转弱。5月固定资产投资累计同比5.6%,比上月回落0.5%,低于市场预期,民间投资增速进一步回落至5.3%,经济内生增长动能不足。房地产开发投资增速继续维持高位,累计同比11.2%,主要是项目施工带来的建筑工程加速上行,但后续土地购置费断崖式下行或将形成拖累。制造业投资增速小幅回升,累计同比2.7%,但企业盈利和融资环境仍然没有得到明显改善,反弹力度将持续性有限。基建投资增速有所下滑,累计同比4%,专项债作为项目资本金落地后的效果预计也很有限。5月PPI同比上涨0.6%,CPI同比上涨2.7%。6月20日,美联储公布6月FOMC议息会议决议,表示鉴于经济增长及通胀前景不确定性上升,去除此前“保持耐心”偏中性的措辞,改为更具降息倾向的“将采取合适行动以保持经济扩张”,降息的概率大幅增加。

二季度A股指数震荡调整,上证综指下跌3.62%,沪深300下跌1.21%,上证50上涨3.24%,创业板指下跌10.75%,中小板指下跌10.99%。在所有行业指数中,食品饮料、家电、银行、餐饮旅游、非银金融等行业涨幅排名靠前。

展望三季度,国内宏观经济面临较大的下行压力,国内制造业景气水平维持低位,投资内生动力不足。近期中美又重新开始贸易谈判,但预计中美贸易摩擦是一个长期的过程。国内政策上对民营企业扶持帮助,国内各方面的应对措施也会根据经济的实际情况逐步推出。金融供给侧改革政策暖风频吹,科创板正有序推进,A股整体有望震荡向上。

报告期内,我们对市场维持中性偏乐观的判断,资产配置上保持了中性偏高的股票仓位。科创板7月推出将提升市场对科技股的重视程度,也将重构科技股的估值体系。我们重点布局了计算机、通信、电子等成长股行业,同时配置了高端制造、新零售等与互联网技术深度融合的方向。

4.5 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1.196元,报告期内,份额净值增长率为1.70%,同期业绩基准增长率为1.00%;本基金C份额净值为1.196元,报告期内,份额净值增长率为0.42%,同期业绩基准增长率为0.98%。

4.6 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,本基金已出现连续六十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,具体时间范围如下:

2019年04月01日至2019年04月10日

基金管理人已根据基金合同及法律法规规定以及本基金实际情况,通过集中营销、向中国证监会报告并提出解决方案等方式积极处理。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	85,001,993.52	17.86
	其中:股票	85,001,993.52	17.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	288,974,400.00	60.71
	其中:债券	288,974,400.00	60.71
	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	66,000,000.00	13.87
	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	28,367,958.71	5.96
8	其他资产	7,662,946.53	1.61
9	合计	476,007,298.76	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

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	3,195,195.98	3.40
B	采矿业	7,100.00	0.01
C	制造业	19,948,170.16	21.21
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	25,334,265.59	26.93
J	金融业	7,622,949.94	8.10
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,897,464.60	2.02
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	3,691,501.00	3.92
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	61,696,647.27	65.58

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	002463	沪电股份	280,800	3,824,496.00	4.07
2	300033	同花顺	38,500	3,786,860.00	4.03
3	300559	佳发教育	156,274	3,705,256.54	3.94
4	002912	中新赛克	38,300	3,595,221.00	3.82
5	002230	科大讯飞	97,300	3,234,252.00	3.44
6	300226	上海钢联	36,300	2,721,048.00	2.89
7	002415	海康威视	81,700	2,253,286.00	2.40
8	300059	东方财富	158,500	2,147,675.00	2.28
9	300496	中科创达	71,100	2,067,588.00	2.20
10	600570	恒生电子	30,200	2,058,130.00	2.