

# 南方荣安定期开放混合型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要

2017 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

送出日期：2017 年 08 月 28 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 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	南方荣安定期开放混合	
基金主代码	003610	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 23 日	
基金管理人	南方基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	744,883,478.80 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方荣安定期开放混合 A	南方荣安定期开放混合 C
下属分级基金的交易代码	003610	003611
报告期末下属分级基金的份额总额	713,122,391.17 份	31,761,087.63 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“南方荣安”。

### 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	本基金的业绩比较基准为：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。

### 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		南方基金管理有限公司	北京银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	鲍文革	刘晔
	联系电话	0755-82763888	010-66223586
	电子邮箱	manager@southernfund.com	liuyel@bankofbeijing.com.cn

客户服务电话	400-889-8899	95526
传真	0755-82763889	010-66225309

## 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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日
	南方荣安定期开放混合 A	南方荣安定期开放混合 C
本期已实现收益	20,720,983.61	857,283.70
本期利润	27,546,699.61	1,160,869.42
加权平均基金份额本期利润	0.0386	0.0366
本期基金份额净值增长率	3.85%	3.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017 年 06 月 30 日）	报告期末（2017 年 06 月 30 日）
期末可供分配基金份额利润	0.0314	0.0289
期末基金资产净值	742,588,917.13	32,994,240.03
期末基金份额净值	1.0413	1.0388

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. 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（为期末余额，不是当期发生数）。

3. 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。

4. 本基金合同生效日为 2016 年 11 月 23 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运行时间未满一年。

## 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

南方荣安定期开放混合 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 (%)
过去一个月	1.72	0.12	1.51	0.12	0.21	0.00
过去三个月	2.09	0.13	0.15	0.13	1.94	0.00
过去六个月	3.85	0.12	-0.25	0.12	4.10	0.00
自基金合同生效 起至今	4.13	0.11	-2.42	0.15	6.55	-0.04
南方荣安定期开放混合 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 (%)
过去一个月	1.69	0.12	1.51	0.12	0.18	0.00
过去三个月	1.98	0.13	0.15	0.13	1.83	0.00
过去六个月	3.64	0.12	-0.25	0.12	3.89	0.00
自基金合同生效 起至今	3.88	0.11	-2.42	0.15	6.30	-0.04

### 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

南方荣安定期开放混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方荣安定期开放混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金合同生效日至本报告期末不满一年。根据相关法律法规和基金合同，本基金的建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期结束时，本基金各项资产配置比例达到基金合同的约定。

## § 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。南方基金总部设在深圳，注册资本

3 亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司（45%）；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，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，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 6,500 亿元，旗下管理 134 只开放式基金，多个全国社保、企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		
王啸	本基金基金经理	2016 年 12 月 28 日		3	香港大学金融学硕士，具有基金从业资格。2013 年 8 月加入南方基金，历任信用分析师、转债研究员、新股研究员。2016 年 3 月至 2016 年 12 月，任南方通利、南方丰元、南方双元的基金经理助理。2016 年 12 月至今，任南方荣光、南方荣冠、南方荣欢、南方荣毅、南方荣安、南方荣发基金经理。
李璇	本基金基金经理	2016 年 11 月 23 日		9	女，清华大学金融学学士、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负责人、固定收益投资决策委员会委员。2010 年 9 月至 2012 年 6 月，担任南方宝元基金经理；2012 年 12 月至 2014 年 9 月，担任南方安心基金经理；2015 年 12 月至 2017 年 2 月，担任南方润元基金经理；2010 年 9 月至今，担任南方多利基金经理；2012 年 5 月至今，担任南方金利基金经理；2013 年 7 月至今，担任南方稳利基金经理；2016 年 8 月至今，担任南方通利、南方丰元、南方荣冠基金经理；2016 年 9 月至今，担任南方多元基金经理；2016 年 11 月至今，任南方荣安基金经理；2016 年 12 月至今，任南方睿见混合基金经理；2017 年 1 月至今，任南方宏元、南方和利基金经理；2017 年 3 月至今，任南方荣优基金经理；2017 年 5 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。
--	--	--	--	--	-----------

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《南方荣安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。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。公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，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、卖出溢价率、交易占优比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

##### 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 2 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型基金成份股调整所致。

#### 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

上半年经济数据整体稳中有升，GDP 同比增速回升至 6.9%，好于市场预期水平。工业增加值累计同比增长 6.9%；固定资产投资累计同比增长 8.6%，其中房地产投资累计同比增长 8.5%，基建投资累计同比增长 16.9%，制造业投资累计同比增长 5.5%；社会消费品零售总额累计同比增长 10.4%。房地产销售面积累计同比增长 16%，新开工面积累计同比增长 11%，土地购置面积累计同比增长 9%。上半年金融数据出现分化，其中 5 月 M2 同比增速 9.6%，历史首次跌破 10%。上半年通胀水平有所下降，其中 6 月 CPI 同比增长 1.5%，缓步回升；6 月 PPI 同比增长 5.5%，较一季



度出现明显回落。美国 6 月会议加息，且声明偏鹰派，表明近期通胀走弱未动摇联储的信心，对经济、通胀的看法仍然乐观，预期年内继续加息一次，并开启缩表。欧央行转向鹰派，德拉吉表示欧洲的通缩因素已被再通胀因素取代。日本方面，市场开始预期日本的经济和通胀将要走出持续的低谷。上半年美元大跌，人民币兑美元汇率中间价明显升值。央行无降息降准操作，但一季度多次上调 MLF、SLF 和公开市场政策利率。上半年来看，市场资金利率水平抬升，波动加大。

债券市场方面，上半年 10 年国开、10 年国债收益率分别上行 52BP、上行 56BP，国开国债短端收益率上行幅度大于长端，利率曲线平坦化。3-5 年高等级信用债整体表现持平于同期限国开债，城投债表现持平于中票，AA 级信用债表现好于 AAA 级信用债。上半年权益市场呈现结构性牛市，以上证 50、中证 100、沪深 300 等为代表的大盘蓝筹引领二八分化行情，分别上涨 11.50%、15.13%和 10.78%。受 IPO 提速、并购收紧、资本市场互联互通推进的大环境影响，成长股为主的创业板已持续下跌两年，今年上半年跌幅为 7.34%。

投资运作上，债券投资方面，组合主要增加了银行同业存单的配置，获取短端的确定性收益。在 6 月份市场上涨过程中，减持信用债并适度增持利率债，维持组合整体久期保持合理水平，同时提高组合的流动性。考虑到下半年债券市场整体表现有望好于上半年，组合在操作上将更加灵活，将择机参与利率债交易。

股票投资方面，以低估值、低波动、高分红股票为主要投资标的，取得了较好的投资效果，并积极参与新股申购，增厚组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期南方荣安 A 级基金净值增长率为 3.85%，同期业绩比较基准增长率为-0.25%；南方荣安 C 级基金净值增长率为 3.64%，同期业绩比较基准增长率为-0.25%。

#### 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 2017 年下半年，经济层面，6 月经济数据显著超预期，PMI 及中观数据也显示经济有所反弹，并未出现明显的快速下行。综合来看，经济整体仍处于高位震荡阶段，下行速度不快。通胀方面，预计下半年 CPI 同比增速缓慢回升，难以突破 2.0%；PPI 同比增速至年中保持缓慢回落，年末将加速回落。

政策层面，美联储将缩表提上议事日程，或从 9 月/12 月正式实施，平均每月 100 亿，每 3 个月提高 100 亿，并最终达到 500 亿/月的水平。当前美元指数大幅下跌，人民币贬值压力明显缓解。当前央行货币政策从收紧转向中性，金融监管预计也将协调统一平稳进行，以防止出现新的金融风险。

利率债方面，金融去杠杆影响暂时淡化，经济稳中有降，货币政策重回中性等都边际利好债

市，但是经济下行速度可控也意味着货币政策难以完全转向，债市上涨空间也将受限。而从历史经验来看，大的债市调整之后，市场也需要用较长的时间才能重回牛市氛围。信用债方面，绝对收益率水平较高，初步具备配置价值。不过在紧信用背景下，企业融资环境恶化，需要严防信用风险，加强对于持仓债券的跟踪和梳理。权益市场方面，稳中有降的经济数据，相对平衡的资金和政策面，难以支持权益市场出现趋势性大行情。下半年转债供给压力较大，转债估值承压，关注供给放量可能带来的配置机会。

#### 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新准则、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。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、权益研究部总监、量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。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同一类别的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。由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的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，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 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

在本报告期内，本基金托管人在托管南方荣安定期开放混合型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关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，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配情况、投资组合报告的内容（“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内），保证复核内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：南方荣安定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	2,412,832.29	303,725,351.30
结算备付金	4,104,602.85	9,359,090.91
存出保证金	130,028.22	-
交易性金融资产	1,000,367,042.57	487,008,706.36
其中：股票投资	122,457,288.07	85,401,321.96
基金投资	-	-
债券投资	877,909,754.50	401,607,384.40
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	187,755.92	-
应收利息	11,192,705.32	6,356,153.96
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,018,394,967.17	806,449,302.53
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017年6月30日</b>	<b>2016年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
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	241,999,515.00	59,000,000.00
应付证券清算款	1,000.00	34,174.53
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	378,780.29	378,808.81
应付托管费	63,130.05	63,134.81
应付销售服务费	10,744.23	10,765.57
应付交易费用	33,778.21	85,156.66
应交税费	-	-
应付利息	136,423.13	1,674.02
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	188,439.10	-
负债合计	242,811,810.01	59,573,714.40
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	744,883,478.80	744,883,478.80
未分配利润	30,699,678.36	1,992,109.33
所有者权益合计	775,583,157.16	746,875,588.13
负债和所有者权益总计	1,018,394,967.17	806,449,302.53

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 744,883,478.80 份，其中 A 类基金份额总额为 713,122,391.17 份，基金份额净值为 1.0413 元；C 类基金份额总额为 31,761,087.63 份，基金份额净值为 1.0388 元。

## 6.2 利润表

会计主体：南方荣安定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	33,330,039.48
1. 利息收入	14,685,938.12
其中：存款利息收入	309,082.99
债券利息收入	14,192,479.33
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	184,375.80
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	11,514,799.64
其中：股票投资收益	10,795,124.51
基金投资收益	-
债券投资收益	-901,267.41
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	1,620,942.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7,129,301.72
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-
<b>减：二、费用</b>	4,622,470.45
1. 管理人报酬	2,255,891.49
2. 托管费	375,981.93
3. 销售服务费	64,039.72
4. 交易费用	166,774.36
5. 利息支出	1,556,252.41
其中：卖出回购金融资产支出	1,556,252.41
6. 其他费用	203,530.54
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	28,707,569.03
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	28,707,569.03

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方荣安定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 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	744,883,478.80	1,992,109.33	746,875,588.13

权益（基金净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	28,707,569.03	28,707,569.03
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）	744,883,478.80	30,699,678.36	775,583,157.16

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 基金基本情况

南方荣安定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2336号《关于准予南方荣安定期开放混合型证券投资基金注册的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方荣安定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币744,634,586.94元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1452号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方荣安定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2016年11月

23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 744,883,478.80 份基金份额，其中认购资金利息折合 248,891.86 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司，基金托管人为北京银行股份有限公司。

根据《南方荣安定期开放混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，并分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方荣安定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、权证以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-30%。开放期内，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*15%+中债综合指数收益率\*85%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2017 年 8 月 27 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方荣安定期开放混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值

变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风



险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的

金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足

一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》

、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 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。

##### 6.4.7.2 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
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
北京银行股份有限公司(“北京银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

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。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 股票交易

注：无。

###### 6.4.8.1.2 权证交易

注：无。

### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

注：无。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,255,891.49
其中：支付销售机构的客户维护费	668,463.92

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	375,981.93

注：支付基金托管人北京银行的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方荣安定期开放混合 A	南方荣安定期开放混合 C	合计
北京银行	-	15,740.90	15,740.90
南方基金	-	500.43	500.43
华泰证券	-	19.91	19.91

合计	-	16,261.24	16,261.24
----	---	-----------	-----------

注：支付销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.8.4.2 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

注：无。

#### 6.4.8.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
北京银行股份有限公司	2,412,832.29	38,197.32

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.9 期末本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017 年 06 月	2017-07-07	新股认购	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-

		05 日								
002882	金龙羽	2017 年 06 月 15 日	2017-07-17	新股认购	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300671	富满电子	2017 年 06 月 27 日	2017-07-05	新股认购	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603305	旭升股份	2017 年 06 月 30 日	2017-07-10	新股认购	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017 年 06 月 27 日	2017-07-05	新股认购	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017 年 06 月 23 日	2017-07-03	新股认购	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017 年 06 月 28 日	2017-07-06	新股认购	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600795	国电电力	2017-06-05	重大资产重组	3.60		-	466,000	1,495,897.70	1,677,600.00	-
601088	中国神华	2017-06-05	重要事项未公告	22.29		-	71,000	1,147,081.30	1,582,590.00	-
000100	TCL集团	2017-04-21	重大事项	3.43	2017-07-26	3.72	412,000	1,428,300.00	1,413,160.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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
011697044	16 渝文资 SCP006	2017-07-03	100.42	40,000	4,016,800.00
011786001	17 杭汽轮 SCP001	2017-07-03	100.24	200,000	20,048,000.00
111710312	17 兴业银行 CD312	2017-07-03	98.92	400,000	39,568,000.00
111716137	17 上海银行 CD137	2017-07-03	98.92	500,000	49,460,000.00
111795624	17 杭州银行 CD093	2017-07-03	98.94	500,000	49,470,000.00
111797831	17 广州农村商业银行 CD088	2017-07-03	98.86	300,000	29,658,000.00
合计				1,940,000	192,220,800.00

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 52,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	122,457,288.07	12.02
	其中：股票	122,457,288.07	12.02
2	固定收益投资	877,909,754.50	86.21
	其中：债券	877,909,754.50	86.21
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,517,435.14	0.64
-	其他各项资产	11,510,489.46	1.13
-	合计	1,018,394,967.17	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

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	2,833,820.00	0.37
C	制造业	58,198,442.75	7.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,477,860.00	1.35
E	建筑业	1,161,600.00	0.15
F	批发和零售业	6,200,065.70	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	13,535,735.50	1.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	-
J	金融业	19,458,034.50	2.51
K	房地产业	7,976,130.00	1.03
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	2,607,960.00	0.34
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	122,457,288.07	15.79

### 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股票投资。

## 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

金额单位：人民币元

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	600741	华域汽车	75,000	1,818,000.00	0.23
2	002372	伟星新材	97,240	1,816,443.20	0.23
3	000069	华侨城 A	180,000	1,810,800.00	0.23
4	000999	华润三九	57,000	1,809,750.00	0.23
5	000333	美的集团	42,000	1,807,680.00	0.23
6	600018	上港集团	280,000	1,775,200.00	0.23
7	600886	国投电力	223,000	1,761,700.00	0.23
8	000429	粤高速 A	206,000	1,759,240.00	0.23
9	600690	青岛海尔	116,000	1,745,800.00	0.23
10	601607	上海医药	60,000	1,732,800.00	0.22

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.nffund.com> 的半年度报告正文。

## 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 名的股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	1,933,336.00	0.26
2	000338	潍柴动力	1,651,390.00	0.22
3	002142	宁波银行	1,516,066.69	0.20
4	000423	东阿阿胶	1,493,030.00	0.20
5	000830	鲁西化工	1,492,555.00	0.20
6	000625	长安汽车	1,470,788.00	0.20
7	600030	中信证券	1,455,108.61	0.19
8	000100	TCL 集团	1,428,300.00	0.19
9	600011	华能国际	1,425,000.00	0.19
10	000623	吉林敖东	1,419,500.00	0.19
11	002078	太阳纸业	1,406,420.00	0.19
12	002202	金风科技	1,394,302.00	0.19
13	000069	华侨城 A	1,388,000.00	0.19
14	000166	申万宏源	1,368,997.50	0.18
15	000600	建投能源	1,359,764.00	0.18
16	601398	工商银行	1,356,000.00	0.18
17	000902	新洋丰	1,355,615.00	0.18

18	002507	涪陵榨菜	1,320,417.00	0.18
19	600335	国机汽车	1,319,643.71	0.18
20	600999	招商证券	1,311,769.00	0.18

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000786	北新建材	2,149,339.58	0.29
2	000858	五粮液	2,132,601.00	0.29
3	000600	建投能源	2,085,640.00	0.28
4	000651	格力电器	2,027,003.00	0.27
5	000418	小天鹅 A	1,984,411.00	0.27
6	600600	青岛啤酒	1,723,235.00	0.23
7	601000	唐山港	1,640,617.00	0.22
8	000089	深圳机场	1,606,057.00	0.22
9	600009	上海机场	1,575,648.50	0.21
10	600196	复星医药	1,547,649.34	0.21
11	002302	西部建设	1,524,274.00	0.20
12	002521	齐峰新材	1,484,096.09	0.20
13	600027	华电国际	1,387,200.00	0.19
14	000001	平安银行	1,335,053.00	0.18
15	600000	浦发银行	1,329,141.00	0.18
16	601628	中国人寿	1,324,762.00	0.18
17	600897	厦门空港	1,294,780.56	0.17
18	002422	科伦药业	1,291,163.00	0.17
19	600266	北京城建	1,238,903.00	0.17
20	601800	中国交建	1,210,327.00	0.16

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	65,794,523.55
卖出股票收入（成交）总额	50,568,111.32

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

**7.5 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	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	19,922,000.00	2.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	48,813,000.00	6.29
	其中：政策性金融债	29,625,000.00	3.82
4	企业债券	105,589,911.40	13.61
5	企业短期融资券	100,273,000.00	12.93
6	中期票据	174,273,000.00	22.47
7	可转债（可交换债）	4,287,843.10	0.55
8	同业存单	424,751,000.00	54.77
9	其他	-	-
-	合计	877,909,754.50	113.19

**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（份）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	111711155	17 平安银行 CD155	500,000	49,475,000.00	6.38
2	111717101	17 光大银行 CD101	500,000	49,475,000.00	6.38
3	111795624	17 杭州银行 CD093	500,000	49,470,000.00	6.38
4	111716137	17 上海银行 CD137	500,000	49,460,000.00	6.38
5	111707126	17 招商银行 CD126	500,000	49,440,000.00	6.37

**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**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 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。

**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**

注：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**

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

**7.11 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

### 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
1	存出保证金	130,028.22
2	应收证券清算款	187,755.92
3	应收股利	-
4	应收利息	11,192,705.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	其他	-
-	合计	11,510,489.46

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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。

## § 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

份额级别	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(%)
南方荣安定期开放混合 A	4,326	164,845.68	159,999,000.00	22.44	553,123,391.17	77.56
南方荣安定期开放	308	103,120.41	-	-	31,761,087.63	100.00

混合 C						
合计	4,634	160,743.09	159,999,000.00	21.48	584,884,478.80	78.52

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方荣安定期开放混合 A	53,034.30	0.0074
	南方荣安定期开放混合 C	0.00	0.0000
	合计	53,034.30	0.0071

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 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的情况

注：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。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方荣安定期开放混合 A	南方荣安定期开放混合 C
基金合同生效日（2016 年 11 月 23 日）基金份额总额	713,122,391.17	31,761,087.63
本报告期期初基金份额总额	713,122,391.17	31,761,087.63
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	713,122,391.17	31,761,087.63

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议已于 2017 年 1 月 23 日审议通过了《公司关于聘任公司副总经理、督察长和财务负责人的议案》，秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投	2	113,453,911.29	100.00	103,320.77	100.00	

注：交易单元的选择标准和程序 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选

择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
中信建投	68,430,300.51	100.00	5,239,800,000.00	100.00	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	20170101-20170630	159,999	-	-	159,99	21.48



			, 000. 00			9, 000. 00
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。						

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。