

# 南华丰淳混合型证券投资基金

## 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人:南华基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期:2019 年 03 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年03月26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。

本报告期自2018年1月1日（基金合同生效日）起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金财产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
8.6 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	57
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
8.8 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	58
8.9 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	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
8.12 投资组合报告附注.....	58
§9 基金份额持有人信息.....	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
9.3 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.....	59
§10 开放式基金份额变动.....	60
§11 重大事件揭示.....	60
11.1 基金份额持有人大会决议.....	60
11.2 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.....	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
11.4 基金投资策略的改变.....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
11.8 其他重大事件.....	62
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
12.1 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.....	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§13 备查文件目录.....	66
13.1 备查文件目录.....	66
13.2 存放地点.....	66
13.3 查阅方式.....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南华丰淳混合型证券投资基金	
基金简称	南华丰淳混合	
基金主代码	005296	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年12月26日	
基金管理人	南华基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	8,027,830.31份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南华丰淳混合A	南华丰淳混合C
下属分级基金的交易代码	005296	005297
报告期末下属分级基金的份额总额	3,030,927.65份	4,996,902.66份

### 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，通过合理的资产配置，综合运用多种投资策略，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪资本市场环境变化，根据对国际及国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、资本市场运行状况等因素的深入研究，分别判断股票和债券等市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析、公司盈利能力与现金流状况，综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上，通过“自上而下”的资产配置及动态调整策略，将基金资产在各类型证券上进行灵活配置。其中，当股票市场资产价格明显上涨时，适当增加股票资产配置比例；当股票市场处于下行周期且市场风险偏好下降时，适当增加债券和现金资产配置比例，并通过灵活运用衍生品合约的套期保值与对冲功能，最终力求实现基金资产组合收益的最大化，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中债综合全价(总值)指数收益率×25%。
风险收益特征	本基金属于混合型基金，风险水平和预期收益高于债券型基金与货

	币市场基金，低于股票型基金。
--	----------------

### 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		南华基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	谢超	田东辉
	联系电话	4008105599	010-68858113
	电子邮箱	services@nanhuafunds.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		4008105599	95580
传真		010-58965908	010-68858120
注册地址		浙江省东阳市横店影视产业 实验区商务楼	北京市西城区金融大街3号
办公地址		北京市东城区东直门南大街 甲3号居然大厦三层	北京市西城区金融大街3号A 座
邮政编码		100007	100808
法定代表人		朱坚	张学文

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.nanhuafunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地 2号楼普华永道中心11楼
注册登记机构	南华基金管理有限公司	北京市东城区东直门南大街甲3号居 然大厦三层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2018年		2017年12月26日（基金合同生效日）-2017年12月31日	
	南华丰淳混合A	南华丰淳混合C	南华丰淳混合A	南华丰淳混合C
本期已实现收益	-1,285,741.74	-5,102,735.78	23,552.04	187,231.04
本期利润	-850,180.75	-6,019,948.96	23,552.04	187,231.04
加权平均基金份额本期利润	-0.1354	-0.1555	0.0007	0.0007
本期加权平均净值利润率	-14.17%	-16.25%	0.07%	0.07%
本期基金份额净值增长率	-28.54%	-29.65%	0.07%	0.07%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末	
期末可供分配利润	-1,231,019.92	-2,075,807.19	23,552.04	187,231.04
期末可供分配基金份额利润	-0.4062	-0.4154	0.0007	0.0007
期末基金资产净值	2,167,419.91	3,517,942.60	32,619,952.59	280,595,362.86
期末基金份额净值	0.7151	0.7040	1.0007	1.0007
3.1.3 累计期末指标	2018年末		2017年末	
基金份额累计净值增长率	-28.49%	-29.60%	0.07%	0.07%

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）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；

(3) 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

南华丰淳混合A

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
过去三个月	-14.39%	1.85%	-8.90%	1.23%	-5.49%	0.62%
过去六个月	-22.45%	1.69%	-10.08%	1.12%	-12.37%	0.57%
过去一年	-28.54%	1.39%	-18.36%	1.00%	-10.18%	0.39%
自基金合同生效起至今	-28.49%	1.37%	-18.52%	0.99%	-9.97%	0.38%

南华丰淳混合C

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
过去三个月	-14.48%	1.85%	-8.90%	1.23%	-5.58%	0.62%
过去六个月	-22.59%	1.69%	-10.08%	1.12%	-12.51%	0.57%
过去一年	-29.65%	1.39%	-18.36%	1.00%	-11.29%	0.39%
自基金合同生效	-29.60%	1.37%	-18.52%	0.99%	-11.08%	0.38%



效起至 今						
----------	--	--	--	--	--	--

### 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

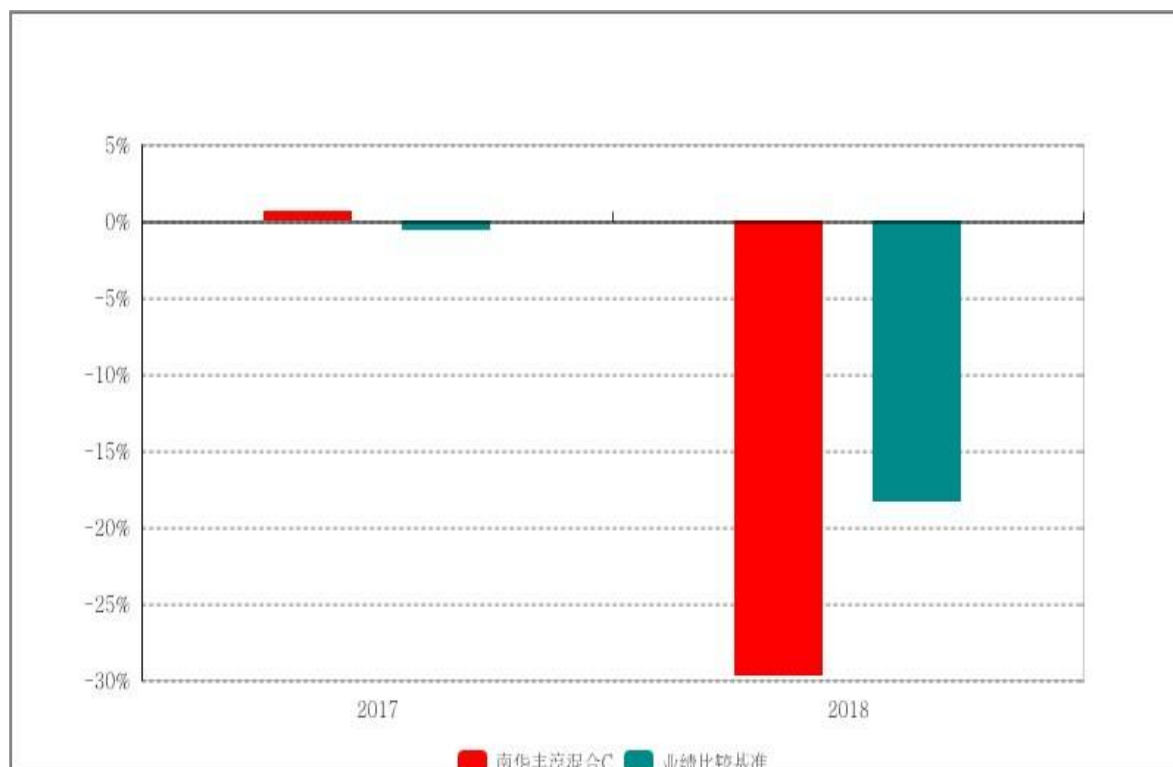
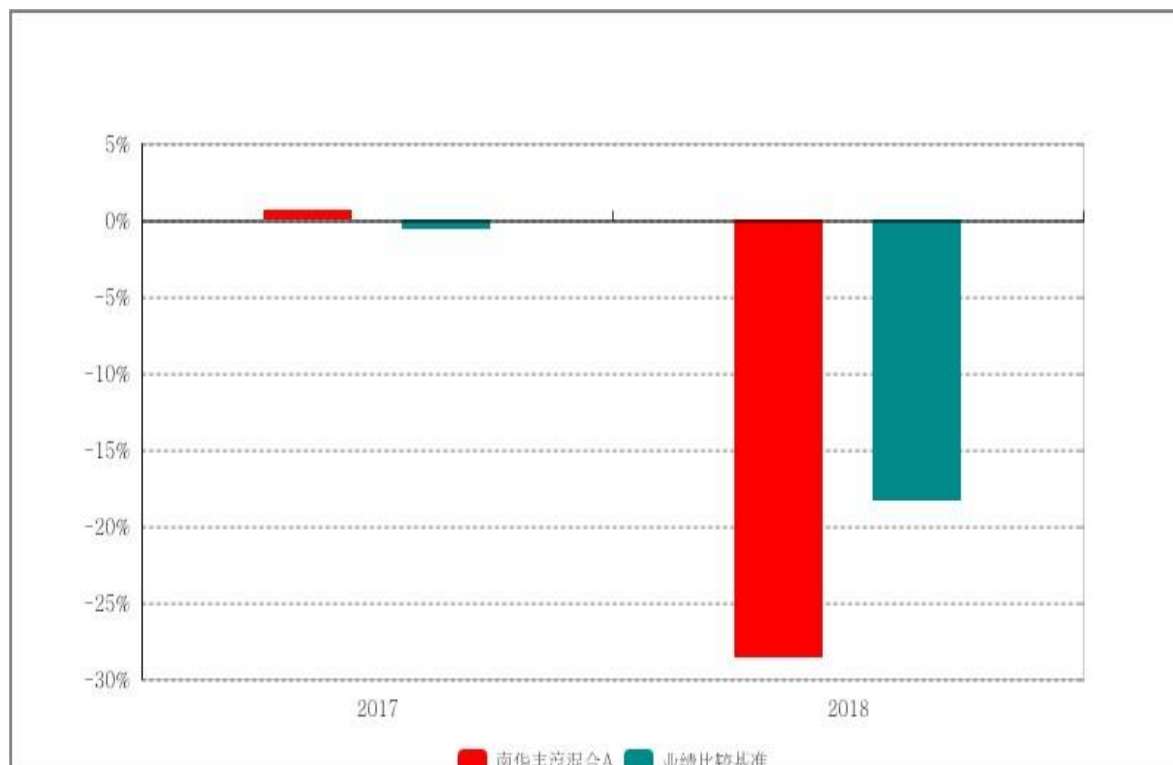




注：

本基金建仓期为 2017 年 12 月 26 日至 2018 年 6 月 25 日，截至本报告期末，本基金已完成建仓，但建仓期结束尚不满 1 年；建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的规定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2017年12月26日）至本报告期末未实施利润分配。

## § 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

南华基金管理有限公司于2016年10月18日经中国证监会核准设立，于2016年11月17日经工商注册登记成立，是国内第一家由期货公司全资控股的公募基金管理公司，股东为南华期货股份有限公司。公司注册资本1.5亿元，注册地为浙江省东阳市横店影视产业实验区商务楼。

截至报告期末，南华基金管理有限公司旗下共管理5只公募基金，分别为南华瑞盈混合型发起式证券投资基金、南华瑞颐混合型证券投资基金、南华丰淳混合型证券投资基金、南华瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金，资产管理规模约41.28亿元。

#### 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		
刘斐	本基金基金经理	2017-12-26	-	9年	硕士研究生，具有基金从业资格。2008年至2009年，任职于天相投资顾问有限公司，担任研究员。2009年至2012年，任职于国都证券有限责任公司，担任研究员。2012年至2013年，任职于长城证券股份有限公司，担任研究员。2013年至2015年，任职于东兴证券股份有限公司，担任研究员。2015年至2017年，任职于泓德基金管理有限公司，担任研究员。2017年3月加入南华基金管理

					有限公司，现任南华丰淳混合型证券投资基金基金经理，南华瑞颐混合型证券投资基金基金经理（2017年12月26日起任职），南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金经理（2017年8月16日起任职）。
曹进前	本基金基金经理	2017-12-26	-	8年	硕士研究生，注册会计师，具有基金从业资格。2008年至2010年任职于毕马威华振会计师事务所，担任审计师。2010年至2015年任职于泰康资产管理有限责任公司，担任年金投资部投资助理。2015年至2017年任职于泓德基金交易部，担任中央交易员、债券交易主管。2017年3月加入南华基金管理有限公司，现任南华丰淳混合型证券投资基金基金经理，南华瑞颐混合型证券投资基金基金经理（2017年12月26日起任职），南华瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2018年3月15日起任职）。

注：

- (1) 基金经理刘斐、曹进前的任职日期是指本基金基金合同生效之日；
- (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合规守信情况的说明

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《南华丰淳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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》以及《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《南华基金管理有限公司公平交易管理细则》，对公平交易的原则与内容、研究支持、投资决策内部控制、交易执行内部控制、行为监控和分析评估、信息披露及外部监督等进行了详细的规范。

本基金管理人根据相关制度建立科学的研究、投资决策、交易、公平交易分析体系，并通过加强交易执行环节内部控制，通过工作流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控，分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《南华基金管理有限公司公平交易管理细则》的规定，通过系统和人工等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投资组合。

在投资决策内部控制方面，本基金管理人确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会；健全投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策；建立投资组合投资信息的管理及保密制度，通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式，使不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行控制方面，本基金管理人实行集中交易制度，交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先，价格优先的原则严格执行所有指令，确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易，按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制及监控制度，报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 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

2018年，A股市场经历了“贸易战”、“经济下行”、“金融去杠杆”、“大规模信用违约”、“质押爆仓”、“计提商誉减值”等诸多象限、维度事件的影响，市场进入技术性熊市，上证综指从年初的最高点3587点下跌至最低点2449点，跌幅达32%；创业板从最高点1918点下跌至1184点，跌幅达38%。

2018年市场的复杂程度超出了市场的预期，我们采取了积极防御的投资策略，通过仓位控制以及行业的轮动来规避系统性、行业以及个股风险。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末南华丰淳混合A基金份额净值为0.7151元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-28.54%，同期业绩比较基准收益率为-18.36%；截至报告期末南华丰淳混合C基金份额净值为0.7040元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-29.65%，同期业绩比较基准收益率为-18.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年4季度起，中国宏观经济出现了类衰退的迹象，宏观经济增速缓慢下降，出口受到贸易战的影响出现明显的下滑，国内消费在地产浪潮退去之后出现了明显减弱迹象，地产、基建投资受到抑制，制造业投资仍未见复苏，上游工业原材料需求下行，经济学家预计中国的本轮经济下行周期有可能在2019年3-4季度触底。

虽然自2018年10月起，党和政府出台了大量稳定宏观经济的政策、指导意见，但政策的实施效果需要一定的时间，并且在“去杠杆”、“防范灰犀牛”的前提下，本轮经济政策力度不会如之前“四万亿”之强，预计会以长效化、渐进式 and 市场化手段为主，因此经济下行周期的转向不会如前几次出现V字形，而会以U型或者L型。

对于证券市场而言，政策底、市场底、经济底依序展开，可以确定的是2018年10月“政策底”已经出现，而在2019年上半年市场底有望出现，且随着经济数据的变化、贸易战谈判的情况、宏观经济政策预期等变化的出现，预计在社融出现趋势性改变之前证券市场仍将维持震荡的格局，而之后将出现趋势性的机会。

行业方面，预计科创板对科技类的行业有极大的提振作用，半导体、5G、物联网、云计算等行业仍将受到政策支持和资金青睐；必选消费品的需求仍能保持稳定；制造业在经历了4、5年的出清之后有望迎来新一轮投资周期；可选消费、医药可能将经历一段时期的出清。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内与本基金相关的内部监察稽核主要工作如下：

在合规稽核方面，本基金管理人以中国证监会“季度监察稽核项目表”为基础，对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，并向监管部门提交季度监察稽核报告。除定期稽核外，本基金管理人还对公司的关键业务部门及业务流程进行检查。在投资研究交易环节，持续对研究报告进行合规性检查，对投资池建立及完善进行跟踪检查，对基金投资比例进行日常监控，对关联交易进行严格管理，对基金持仓流动性风险持续关注，并对公平交易执行情况进行检查等等；在营销方面，本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性进行检查；在基金的运营方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值业务的检查来确保本基金财务数据的准确性；在反洗钱工作方面，本基金管理人根据监管机构要求制定并实施反洗钱专门制度和 workflows，落实洗钱风险监测标准制定和实施，在开户环节和日常业务中严格反洗钱客户身份识别，可疑客户和可疑交易筛查和分析，防控反洗钱风险。

本基金管理人在事中、事后等阶段对基金投资合规情况及风险情况进行严格的内部监控和管理。报告期内，本基金的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定，未出现利益输送、内幕交易及其他损害基金投资者利益的行为。本基金的投资目标、投资决策依据和投资管理程序均符合相关基金合同和招募说明书的约定。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

会计师事务所对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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未实施利润分配。

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

本基金报告期内存在连续60个工作日基金资产净值低于五千万的情形，时间段为2018年9月26日至2018年12月31日。本基金报告期内存在连续20个工作日基金份额持有



人数低于200人的情形，时间段为2018年10月18日至2018年12月31日。本基金管理人已向中国证监会提交解决方案，将根据所提方案开展后续工作。

## § 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在南华丰淳证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第20944号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南华丰淳混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容

	<p>我们审计了南华丰淳混合型证券投资基金(以下简称“南华丰淳混合基金”)的财务报表,包括2018年12月31日和2017年12月31日的资产负债表,2018年度和2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了南华丰淳混合基金2018年12月31日和2017年12月31日的财务状况以及2018年度和2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于南华丰淳混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	
其他事项	
其他信息	
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>南华丰淳混合基金的基金管理人南华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执</p>

	<p>行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估南华丰淳混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算南华丰淳混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南华丰淳混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>

	<p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对南华丰淳混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致南华丰淳混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张勇、郭蕙心
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
审计报告日期	2019年3月22日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：南华丰淳混合型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	891,903.32	177,004,532.37
结算备付金		10,604.70	-
存出保证金		88,773.46	-
交易性金融资产	7.4.7.2	4,883,400.17	-
其中：股票投资		4,883,400.17	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	134,000,000.00
应收证券清算款		-	2,003,281.91
应收利息	7.4.7.5	248.04	284,533.21
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,874,929.69	313,292,347.49
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年12月31日</b>	<b>上年度末 2017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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,036.32	51,467.64
应付托管费		1,006.06	8,577.94
应付销售服务费		1,247.40	15,369.22
应付交易费用	7.4.7.7	31,277.40	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	150,000.00	1,617.24
负债合计		189,567.18	77,032.04
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	8,027,830.31	313,004,532.37
未分配利润	7.4.7.10	-2,342,467.80	210,783.08
所有者权益合计		5,685,362.51	313,215,315.45
负债和所有者权益总计		5,874,929.69	313,292,347.49

注：

1. 报告截止日2018年12月31日，基金份额总额8,027,830.31份。其中南华丰淳混合A类基金份额净值0.7151元，基金份额总额3,030,927.65份；南华丰淳混合C类基金份额净值0.7040元，基金份额总额4,996,902.66份。截至2017年12月31日，基金份额总额313,004,532.37份，其中南华丰淳混合A类基金份额净值1.0007元，基金份额总额32,596,400.55份；南华丰淳混合C类基金份额净值1.0007元，基金份额总额280,408,131.82份。
2. 本财务报表的实际编制期间为2018年度和2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日。

## 7.2 利润表

会计主体：南华丰淳混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同生效日）至2017年12月31日
<b>一、收入</b>		-5,688,671.08	287,815.12
1. 利息收入		1,470,156.45	287,815.12
其中：存款利息收入	7.4.7.11	979,515.55	160,465.30
债券利息收入		1,293.00	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		489,347.90	127,349.82
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,799,873.78	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-6,859,163.21	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	11,986.48	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	47,302.95	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-481,652.19	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	122,698.44	-
<b>减：二、费用</b>		1,181,458.63	77,032.04
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	513,061.93	51,467.64

2. 托管费	7.4.10.2. 2	85,510.38	8,577.94
3. 销售服务费	7.4.10.2. 3	147,232.69	15,369.22
4. 交易费用	7.4.7.19	286,867.10	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3.77	-
7. 其他费用	7.4.7.20	148,782.76	1,617.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,870,129.71	210,783.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,870,129.71	210,783.08

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南华丰淳混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31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）	313,004,532.37	210,783.08	313,215,315.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,870,129.71	-6,870,129.71
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）	-304,976,702.06	4,316,878.83	-300,659,823.23



其中：1. 基金申购款	103,619,690.18	-9,096,584.30	94,523,105.88
2. 基金赎回款	-408,596,392.24	13,413,463.13	-395,182,929.11
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）	8,027,830.31	-2,342,467.80	5,685,362.51
项 目	上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同生效日）至2017年12月31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）	313,004,532.37	-	313,004,532.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	210,783.08	210,783.08
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）	313,004,532.37	210,783.08	313,215,315.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

朱坚

程海霞

连省

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

南华丰淳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[2017]1786号《关于准予南华丰淳混合型证券投资基金注册的批复》核准,由南华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《南华丰淳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,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312,945,459.35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(2017)第1113号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南华丰淳混合型证券投资基金基金合同》于2017年12月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为313,004,532.37份基金份额,其中认购资金利息折合59,073.02份基金份额。本基金的基金管理人为南华基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《南华丰淳混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,赎回时收取赎回费用,且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;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,赎回时收取赎回费用,且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类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南华丰淳混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、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、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、股指期货、国债期货、权证、同业存单、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款)以及现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%。每个交易日日

终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率 $\times$ 75% + 中债综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 25%。

本财务报表由本基金的基金管理人南华基金管理有限公司于2019年3月22日批准报出。

#### 7.4.2 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<年度报告和半年度报告>》、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》、《南华丰淳混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于2018年12月31日，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度和2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的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2018年12月31日和2017年12月31日的财务状况以及2018年度和2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为2018年度和2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 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、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期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。

#### 7.4.4.4 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或资产支持证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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值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。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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和债券，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[2017]13号《中国证监会关于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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 于2017年12月29日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，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〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自2017年12月29日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
活期存款	891,903.32	17,004,532.37
定期存款	-	160,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	160,000,000.00
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	891,903.32	177,004,532.37

注：定期存款的存款期限指票面存期。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,365,052.36	4,883,400.17	-481,652.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,365,052.36	4,883,400.17	-481,652.19
项目		上年度末2017年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		-	-	-

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末2017年12月31日	

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	134,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	134,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	198.98	36,020.90
应收定期存款利息	-	124,444.40
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	5.17	-
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	124,067.91
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	43.89	-
合计	248.04	284,533.21

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	31,277.40	-

银行间市场应付交易费用	-	-
合计	31,277.40	-

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	150,000.00	1,617.24
合计	150,000.00	1,617.24

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 南华丰淳混合A

金额单位：人民币元

项目 (南华丰淳混合A)	本期2018年01月01日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	32,596,400.55	32,596,400.55
本期申购	43,690.37	43,690.37
本期赎回(以“-”号填列)	-29,609,163.27	-29,609,163.27
本期末	3,030,927.65	3,030,927.65

##### 7.4.7.9.2 南华丰淳混合C

金额单位：人民币元

项目 (南华丰淳混合C)	本期2018年01月01日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	280,408,131.82	280,408,131.82
本期申购	103,575,999.81	103,575,999.81
本期赎回(以“-”号填列)	-378,987,228.97	-378,987,228.97
本期末	4,996,902.66	4,996,902.66

注：

1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自2017年11月20日至2017年12月20日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币312,945,459.35元，折合为312,945,459.35份基金份额。根据《南华丰淳混合型证券投资基金基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币59,073.02元在本基金成立后，折算为59,073.02份基金份额，划入基金份额持有人账户。
3. 根据《南华丰淳混合型证券投资基金招募说明书》和《南华丰淳混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2017年12月26日(基金合同生效日)至2018年1月25日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务、转换业务和定期定额投资业务自2018年1月26日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 南华丰淳混合A

单位：人民币元

项目 (南华丰淳混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,552.04	-	23,552.04
本期利润	-1,285,741.74	435,560.99	-850,180.75
本期基金份额交易产生的变动数	31,169.78	-68,048.81	-36,879.03
其中：基金申购款	-54.97	-70.80	-125.77
基金赎回款	31,224.75	-67,978.01	-36,753.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,231,019.92	367,512.18	-863,507.74

##### 7.4.7.10.2 南华丰淳混合C

单位：人民币元

项目 (南华丰淳混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	187,231.04	-	187,231.04
本期利润	-5,102,735.78	-917,213.18	-6,019,948.96
本期基金份额交易产生的变动数	2,839,697.55	1,514,060.31	4,353,757.86
其中：基金申购款	-5,102,597.94	-3,993,860.59	-9,096,458.53

基金赎回款	7,942,295.49	5,507,920.90	13,450,216.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,075,807.19	596,847.13	-1,478,960.06

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年12月26日（基金合同生效日）至2017年12月31日
活期存款利息收入	57,648.37	36,020.90
定期存款利息收入	917,400.05	124,444.40
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	3,715.02	-
其他	752.11	-
合计	979,515.55	160,465.30

注：于2018年度，本基金未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情况（于2017年12月26日（基金合同生效日）至2017年12月31日止期间：同）。

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
卖出股票成交总额	105,441,859.45	-
减：卖出股票成本总额	112,301,022.66	-
买卖股票差价收入	-6,859,163.21	-

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至20	上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同生
----	----------------------	------------------------------

	18年12月31日	效日) 至2017年12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	11,986.48	-
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	11,986.48	-

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年12月26日(基金合同生效日) 至2017年12月31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑 付)成交总额	2,560,298.39	-
减:卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付)成本总额	2,542,502.21	-
减:应收利息总额	5,809.70	-
买卖债券差价收入	11,986.48	-

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

## 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	47,302.95	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	47,302.95	-

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------



	2018年01月01日至2018年12月31日	2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-481,652.19	-
——股票投资	-481,652.19	-
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-481,652.19	-

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日
基金赎回费收入	122,698.44	-
合计	122,698.44	-

注：本基金的赎回费率按持有期间递减。对于持有期少于30日的南华丰淳混合A类基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于30日但少于3个月的南华丰淳混合A类基金份额所收取的赎回费，赎回费用75%归入基金财产；对于持有期长于3个月但小于6个月的南华丰淳混合A类基金份额所收取的赎回费，赎回费用50%归入基金财产；对于持有期长于6个月的南华丰淳混合A类基金份额所收取的赎回费，赎回费用25%归入基金财产。对于持有期少于30日的南华丰淳混合C类基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于(含等于)30日的南华丰淳混合C类基金份额不收取赎回费。

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
交易所市场交易费用	286,867.10	-
银行间市场交易费用	-	-
合计	286,867.10	-

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同生效 日）至2017年12月31日
审计费用	50,000.00	-
信息披露费	98,382.76	1,617.24
其他	400.00	-
合计	148,782.76	1,617.24

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

无。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南华基金管理有限公司（“南华基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储蓄银行”）	基金托管人
南华期货股份有限公司（“南华期货公司”）	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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同 生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	513,061.93	51,467.64
其中：支付销售机构的客户维护费	124,120.84	14,250.48

注：支付基金管理人南华基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%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×1.20%/当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018年01月01日 至2018年12月31 日	2017年12月26日（基金合同生 效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	85,510.38	8,577.94

注：支付基金托管人中国邮政储蓄银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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×0.20%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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 2018年01月01日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南华丰淳混合A	南华丰淳混合C	合计
南华基金管理有限公司	-	68,746.27	68,746.27
南华期货	-	44.62	44.62
合计	-	68,790.89	68,790.89
获得销售服务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同生效日）至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南华丰淳混合A	南华丰淳混合C	合计
南华基金管理有限公司	-	4,607.19	4,607.19
南华期货	-	0.70	0.70
合计	-	4,607.89	4,607.89

注：支付基金销售机构的销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南华基金，再由南华基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日C类基金份额销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

## 7.4.10.4.2 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

无。

## 7.4.10.5 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 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年12月26日（基金合同生效日） 至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司—活期存款	891,903.32	57,648.37	17,004,532.37	36,020.90

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，按约定利率计息。

## 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

无。

## 7.4.12 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，风险水平和预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，综合运用多种投资策略，力争实现基金资产的持续稳健增值。

本基金的基金管理人建立了全面风险管理体系，在董事会下设立风险控制委员会，根据公司总体战略负责拟订公司风险战略和风险管理政策，并对其实施情况及效果进行监督和评价，指导公司的风险管理和内控制度建设；对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估；监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评估公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和通行的会计标准。在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责制定公司经营管理中的风险控制政策，组织制定公司经营管理中的内部风险控制制度；对公司在投资、市场、信用、操作等方面的风险控制情况进行监督；以及对公司经营管理过程中的风险状况进行定期或不定期评估。在业务操作层面，监察稽核部负责公司旗下基金及其它受托资产投资中的风险识别、评估和控制并承担其他风险的管理职责，负责在各业务部门一线风险控制的基础上实施风险再控制。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告等确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国邮政储蓄银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2018年12月31日，本基金未持有债券投资(2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日：同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2018年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

##### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。



本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	891,903.32	-	-	-	891,903.32
结算备付金	10,604.70	-	-	-	10,604.70
存出保证金	88,773.46	-	-	-	88,773.46
交易性金融资产	-	-	-	4,883,400.17	4,883,400.17
应收利息	-	-	-	248.04	248.04
资产总计	991,281.48	-	-	4,883,648.21	5,874,929.69
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	6,036.32	6,036.32
应付托管费	-	-	-	1,006.06	1,006.06
应付销售服务费	-	-	-	1,247.40	1,247.40
应付交易费用	-	-	-	31,277.40	31,277.40
其他负债	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	189,567.18	189,567.18
利率敏感度缺口	991,281.48	-	-	4,694,081.03	5,685,362.51
上年度末2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	177,004,532.37	-	-	-	177,004,532.37

交易性金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	134,000,000.00	-	-	-	134,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	2,003,281.91	2,003,281.91
应收利息	-	-	-	284,533.21	284,533.21
资产总计	311,004,532.37	-	-	2,287,815.12	313,292,347.49
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	51,467.64	51,467.64
应付托管费	-	-	-	8,577.94	8,577.94
应付销售服务费	-	-	-	15,369.22	15,369.22
其他负债	-	-	-	1,617.24	1,617.24
负债总计	-	-	-	77,032.04	77,032.04
利率敏感度缺口	311,004,532.37	-	-	2,210,783.08	313,215,315.45

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2018年12月31日，本基金未持有债券投资(2017年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017年12月31日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合中股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,883,400.17	85.89	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,883,400.17	85.89	-	-

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	91,549.12	-
	2. 业绩比较基准下降5%	-91,549.12	-

注：于2017年12月31日，本基金运作尚不足一年，无足够经验数据。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为4,883,400.17元，无属于第二层次和第三层次的余额(2017年12月31日：本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	4,883,400.17	83.12
	其中：股票	4,883,400.17	83.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	902,508.02	15.36
8	其他各项资产	89,021.50	1.52
9	合计	5,874,929.69	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	54,625.00	0.96
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,973,836.17	52.31

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	57,000.00	1.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	118,420.00	2.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,265,021.00	22.25
J	金融业	-	-
K	房地产业	176,850.00	3.11
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	65,500.00	1.15
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	172,148.00	3.03
S	综合	-	-
	合计	4,883,400.17	85.89

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600702	舍得酒业	14,300	326,326.00	5.74
2	300059	东方财富	23,000	278,300.00	4.90
3	600570	恒生电子	5,300	275,494.00	4.85
4	300596	利安隆	6,100	189,100.00	3.33
5	600436	片仔癀	2,100	181,965.00	3.20
6	600562	国睿科技	13,777	177,309.99	3.12
7	600048	保利地产	15,000	176,850.00	3.11

8	601766	中国中车	19,500	175,890.00	3.09
9	002371	北方华创	4,500	169,920.00	2.99
10	002821	凯莱英	2,500	169,625.00	2.98
11	300036	超图软件	9,000	164,970.00	2.90
12	300339	润和软件	17,000	155,040.00	2.73
13	000977	浪潮信息	9,300	148,056.00	2.60
14	600585	海螺水泥	5,000	146,400.00	2.58
15	601100	恒立液压	7,278	144,177.18	2.54
16	002410	广联达	6,700	139,427.00	2.45
17	300188	美亚柏科	10,000	130,200.00	2.29
18	300604	长川科技	4,000	122,400.00	2.15
19	002912	中新赛克	1,500	121,590.00	2.14
20	600312	平高电气	15,000	121,200.00	2.13
21	600315	上海家化	4,400	120,120.00	2.11
22	601111	中国国航	15,500	118,420.00	2.08
23	000681	视觉中国	5,000	116,600.00	2.05
24	300001	特锐德	6,500	113,945.00	2.00
25	000908	景峰医药	25,000	111,000.00	1.95
26	300760	迈瑞医疗	1,000	109,220.00	1.92
27	600893	航发动力	5,000	108,600.00	1.91
28	600276	恒瑞医药	1,900	100,225.00	1.76
29	603005	晶方科技	4,000	65,680.00	1.16
30	300012	华测检测	10,000	65,500.00	1.15
31	600038	中直股份	1,700	63,512.00	1.12
32	300648	星云股份	3,500	57,505.00	1.01
33	601668	中国建筑	10,000	57,000.00	1.00
34	603096	新经典	900	55,548.00	0.98
35	002714	牧原股份	1,900	54,625.00	0.96
36	300750	宁德时代	700	51,660.00	0.91

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 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

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	002415	海康威视	4,671,042.00	1.49
2	600019	宝钢股份	4,427,290.00	1.41
3	600048	保利地产	3,830,591.24	1.22
4	601111	中国国航	3,800,634.00	1.21
5	601100	恒立液压	3,729,907.56	1.19
6	601088	中国神华	3,426,250.00	1.09
7	601668	中国建筑	2,970,587.00	0.95
8	002371	北方华创	2,708,917.00	0.86
9	600028	中国石化	2,703,380.00	0.86
10	002410	广联达	2,698,779.30	0.86
11	000729	燕京啤酒	2,556,398.00	0.82
12	603019	中科曙光	2,552,930.00	0.82
13	300036	超图软件	2,497,978.00	0.80
14	002368	太极股份	2,137,254.00	0.68
15	002327	富安娜	2,069,904.00	0.66
16	600436	片仔癀	2,055,743.00	0.66
17	600104	上汽集团	2,032,972.00	0.65
18	300251	光线传媒	2,032,896.00	0.65
19	600585	海螺水泥	2,000,603.00	0.64
20	600887	伊利股份	1,975,178.00	0.63

## 8.4.2 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

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	002415	海康威视	4,340,183.55	1.39
2	600019	宝钢股份	4,254,733.00	1.36



3	601111	中国国航	3,512,668.00	1.12
4	601088	中国神华	3,468,598.00	1.11
5	600048	保利地产	3,419,696.00	1.09
6	601100	恒立液压	3,397,788.72	1.08
7	601668	中国建筑	2,863,621.00	0.91
8	600028	中国石化	2,616,859.00	0.84
9	000729	燕京啤酒	2,484,838.00	0.79
10	002410	广联达	2,374,653.05	0.76
11	300036	超图软件	2,179,208.00	0.70
12	603019	中科曙光	2,153,847.00	0.69
13	002371	北方华创	2,071,568.00	0.66
14	002327	富安娜	2,016,052.00	0.64
15	600104	上汽集团	1,983,424.31	0.63
16	300251	光线传媒	1,939,736.25	0.62
17	600887	伊利股份	1,899,143.00	0.61
18	002368	太极股份	1,817,513.00	0.58
19	600436	片仔癀	1,781,838.80	0.57
20	000651	格力电器	1,754,353.00	0.56

#### 8.4.3 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	117,666,075.02
卖出股票收入（成交）总额	105,441,859.45

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

**8.8 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投资。

**8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1 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。**

**8.12.2 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。**

**8.12.3 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	88,773.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	248.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	89,021.50

**8.12.4 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。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 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
南华 丰淳 混合A	49	61,855.67	-	-	3,030,927.6 5	100.0 0%
南华 丰淳 混合C	140	35,692.16	2,315,535.07	46.3394%	2,681,367.5 9	53.660 6%
合计	189	42,475.29	2,315,535.07	28.8438%	5,712,295.2 4	71.156 2%

## 9.2 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	南华丰淳混合A	-	-
	南华丰淳混合C	51,009.05	1.0208%
	合计	51,009.05	0.6354%

## 9.3 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

项目	份额级别	持有基金份额总量 的数量区间（万份）
----	------	-----------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	南华丰淳混合A	-
	南华丰淳混合C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	南华丰淳混合A	-
	南华丰淳混合C	0~10
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	南华丰淳混合A	南华丰淳混合C
基金合同生效日(2017年12月26 日)基金份额总额	32,596,400.55	280,408,131.82
本报告期期初基金份额总额	32,596,400.55	280,408,131.82
本报告期基金总申购份额	43,690.37	103,575,999.81
减：本报告期基金总赎回份额	29,609,163.27	378,987,228.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,030,927.65	4,996,902.66

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

经南华基金管理有限公司第一届董事会第十次会议审议通过，并按规定向中国证券投资基金业协会报备，基金管理人于2018年5月18日发布高级管理人员变更公告，自2018年5月17日起，武伟先生不再担任本基金管理人督察长，并由总经理路秀妍女士代任督察长职务。

经南华基金管理有限公司第一届董事会第十一次会议审议通过，并按规定向中国证券投资基金业协会报备，基金管理人于2018年6月21日发布高级管理人员任职公告，自2018年6月20日起，聘任陈琨先生担任公司副总经理。

经南华基金管理有限公司第一届董事会第十三次会议审议通过，经中国证券监督管理委员会审批，并按规定向中国证券投资基金业协会报备，基金管理人于2018年9月28日发布高级管理人员任职公告，自2018年9月25日起，聘任程海霞女士担任本基金管理人督察长，总经理路秀妍女士不再代任督察长职务。

经南华基金管理有限公司第一届董事会第十五次会议审议通过，并按规定向中国证券投资基金业协会报备，基金管理人于2018年12月5日发布高级管理人员变更公告，自2018年12月3日起，聘任朱坚先生担任本基金管理人法定代表人及总经理，路秀妍女士不再担任本基金管理人法定代表人及总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立之日（2017年12月26日）起，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）持续为本基金提供审计服务。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务满1年，本报告期内本基金应支付其的报酬金额为人民币50000元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
开源证券	2	16,057,284.76	7.20%	11,742.75	7.27%	-

中信证券	2	79,616,929.27	35.69%	56,631.26	35.05%	-
方正证券	2	127,433,720.44	57.12%	93,191.99	57.68%	-

注：

#### 1、交易单元的选择标准：

- (1) 证券经营机构经营业务全面，资力雄厚，信誉良好且财务状况良好；
- (2) 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，建立相关业务利益冲突防范机制，完善隔离墙制度，确保研究、投行服务客观公正，并能满足基金资金投资运作高度保密的要求；
- (3) 研究实力强，有独立的研究部门和50人以上的研究团队，能提供宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、推荐模拟组合、债券分析报告、个股分析报告及其他专门报告。

2、证券交易单元选择程序由基金管理人研究部发起立项申请，并联合相关部门根据评分标准对拟选择证券经营机构从不同角度进行评估、打分；研究部汇总评分结果，呈报公司领导审批后，基金管理人与选定证券经营机构签订证券交易单元租用协议。

#### 11.7.2 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
开源证券	501,284.22	9.83%	-	-	-	-	-	-
中信证券	119,417.45	2.34%	-	-	-	-	-	-
方正证券	4,480,468.05	87.83%	204,800,000.00	100.00%	-	-	-	-

#### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南华基金管理有限公司关于南华丰淳混合型证券投资基金参与部分代销机构开展的申购费率优惠及定期定额投资费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站	2018-01-24
2	南华丰淳混合型证券投资基金开放	《证券日报》、基金	2018-01-24

	日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	管理人网站	
3	南华基金管理有限公司关于旗下基金参加大泰金石基金销售有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券日报》、基金管理人网站	2018-01-27
4	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增中信建投证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	《证券日报》、基金管理人网站	2018-02-07
5	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金在联讯证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	《证券日报》、基金管理人网站	2018-02-10
6	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增泰诚财富基金销售（大连）有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券日报》、基金管理人网站	2018-02-28
7	南华基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券日报》、基金管理人网站	2018-03-30
8	南华丰淳混合型证券投资基金2018年第一季度报告（正文及摘要）	《证券日报》、基金管理人网站	2018-04-21
9	南华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《证券日报》、《证券时报》、基金管理人网站	2018-05-18
10	南华基金管理有限公司高级管理人员任职公告	《中国证券报》、《证券日报》、《证券时报》、基金管理人网站	2018-06-21
11	南华基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券日报》、基金管理人网站	2018-06-30

12	南华丰淳混合型证券投资基金2018年第二季度报告（正文及摘要）	《证券日报》、基金管理人网站	2018-07-18
13	南华丰淳混合型证券投资基金招募说明书更新（2018年第1号）	《证券日报》、基金管理人网站	2018-07-27
14	南华丰淳混合型证券投资基金2018年半年度报告（正文及摘要）	《证券日报》、基金管理人网站	2018-08-27
15	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增中国银河证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券日报》、基金管理人网站	2018-09-19
16	南华基金管理有限公司高级管理人员任职公告	《中国证券报》、《证券日报》、《证券时报》、基金管理人网站	2018-09-28
17	南华基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券日报》、基金管理人网站	2018-09-29
18	南华丰淳混合型证券投资基金2018年第3季度报告（正文及摘要）	《证券日报》、基金管理人网站	2018-10-26
19	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增深圳前海财厚基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	《证券日报》、基金管理人网站	2018-11-29
20	南华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》、《证券时报》、基金管理人网站	2018-12-05
21	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增西藏东方财富证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券日报》、基金管理人网站	2018-12-20

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息



12.1 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	2018.08.20-2018.12.31	-	5,815,535.07	3,500,000.00	2,315,535.07	28.84%
	2	2018.01.29-2018.01.30	30,000,675.00	-	30,000,675.00	-	-
	3	2018.02.07-2018.02.11	8,000,360.00	-	8,000,360.00	-	-
	4	2018.05.02-2018.06.05	-	12,386,457.47	12,386,457.47	-	-
	5	2018.05.03-2018.10.09	-	49,602,460.25	49,602,460.25	-	-
	6	2018.08.29-2018.10.17	-	12,728,535.06	12,728,535.06	-	-
	7	2018.10.10-2018.10.16	-	6,942,837.31	6,942,837.31	-	-
个人	1	2018.02.06-2018.02.06	10,003,500.00	-	10,003,500.00	-	-
	2	2018.05.02-2018.05.02	-	10,322,047.89	10,322,047.89	-	-

产品特有风险

基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：

- (1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；
- (2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；
- (3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；
- (4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；
- (5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予南华丰淳混合型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《南华丰淳混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《南华丰淳混合型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《南华丰淳混合型证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内南华丰淳混合型证券投资基金在指定报刊披露的各项公告原稿。

### 13.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街甲3号居然大厦3层南华基金管理有限公司

### 13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查询，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址[www.nanhuafunds.com](http://www.nanhuafunds.com)

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人南华基金管理有限公司，咨询电话400-810-5599。

南华基金管理有限公司  
二〇一九年三月二十七日