

南方亚洲美元收益债券型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 8 月 23 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	37
7.5 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	37
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	38
7.7 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.....	38
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	38
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	38

7.10 投资组合报告附注.....	39
§8 基金份额持有人信息.....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
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情况.....	40
§9 开放式基金份额变动.....	40
§10 重大事件揭示.....	41
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
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.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
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.....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§12 备查文件目录.....	48
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方亚洲美元收益债券型证券投资基金
基金简称	南方亚洲美元收益债券（QDII）
基金主代码	002400
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月3日
报告期末基金份额总额	1,312,252,966.29份
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同存续期	不定期

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“南方亚洲美元债”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及发债主体的微观基本面，寻找各类债券的投资机会，在谨慎前提下力争实现长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将根据宏观经济、基准利率水平，分析债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，做出最佳的资产配置及风险控制。本基金采用自上而下的宏观分析和自下而上的信用分析相结合的方法，挖掘相对价值被低估的债券，构建分散化的投资组合。
业绩比较基准	美元一年银行定期存款利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	010-66105798
注册地址	深圳市福田区莲花街道	北京市西城区复兴门内大街

	益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	55 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518017	100140
法定代表人	张海波	陈四清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外资产托管人	
名称	中文	美国北美信托银行有限公司
	英文	The Northern Trust Company
注册地址	50 South La Salle Street, Chicago, Illinois 60603 U.S.A.	
办公地址	50 South La Salle Street, Chicago, Illinois 60603 U.S.A.	
邮政编码	60603	

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

§ 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

1、南方亚洲美元债 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	51,590,561.72
本期利润	80,936,308.29
加权平均基金份额本期利润	0.0780
本期加权平均净值利润率	6.88%
本期基金份额净值增长率	7.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	92,781,600.29
期末可供分配基金份额利润	0.0972
期末基金资产净值	1,130,104,216.71
期末基金份额净值	1.1846
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	18.46%

2、南方亚洲美元债 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	18,027,318.31
本期利润	29,553,935.16
加权平均基金份额本期利润	0.0757
本期加权平均净值利润率	6.77%
本期基金份额净值增长率	7.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	28,286,428.87
期末可供分配基金份额利润	0.0790
期末基金资产净值	417,070,192.72
期末基金份额净值	1.1653
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	16.53%

1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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、对期末可供分配利润，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

南方亚洲美元债 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
过去一个月	0.90%	0.16%	0.14%	0.00%	0.76%	0.16%
过去三个月	4.42%	0.16%	0.44%	0.00%	3.98%	0.16%
过去六个月	7.26%	0.21%	0.87%	0.00%	6.39%	0.21%
过去一年	9.59%	0.25%	1.82%	0.00%	7.77%	0.25%
过去三年	13.57%	0.23%	5.34%	0.00%	8.23%	0.23%
自基金合同生效起至今	18.46%	0.23%	6.25%	0.00%	12.21%	0.23%

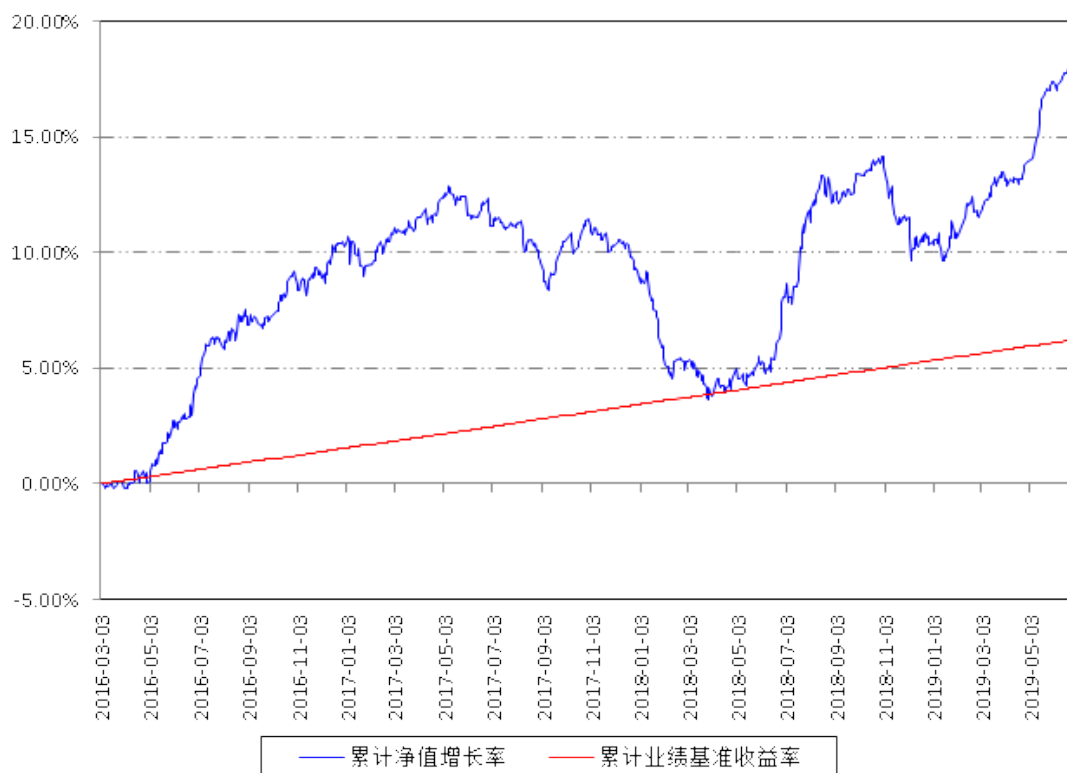
南方亚洲美元债 C

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
过去一个月	0.87%	0.16%	0.14%	0.00%	0.73%	0.16%
过去三个月	4.29%	0.16%	0.44%	0.00%	3.85%	0.16%
过去六个月	7.00%	0.21%	0.87%	0.00%	6.13%	0.21%

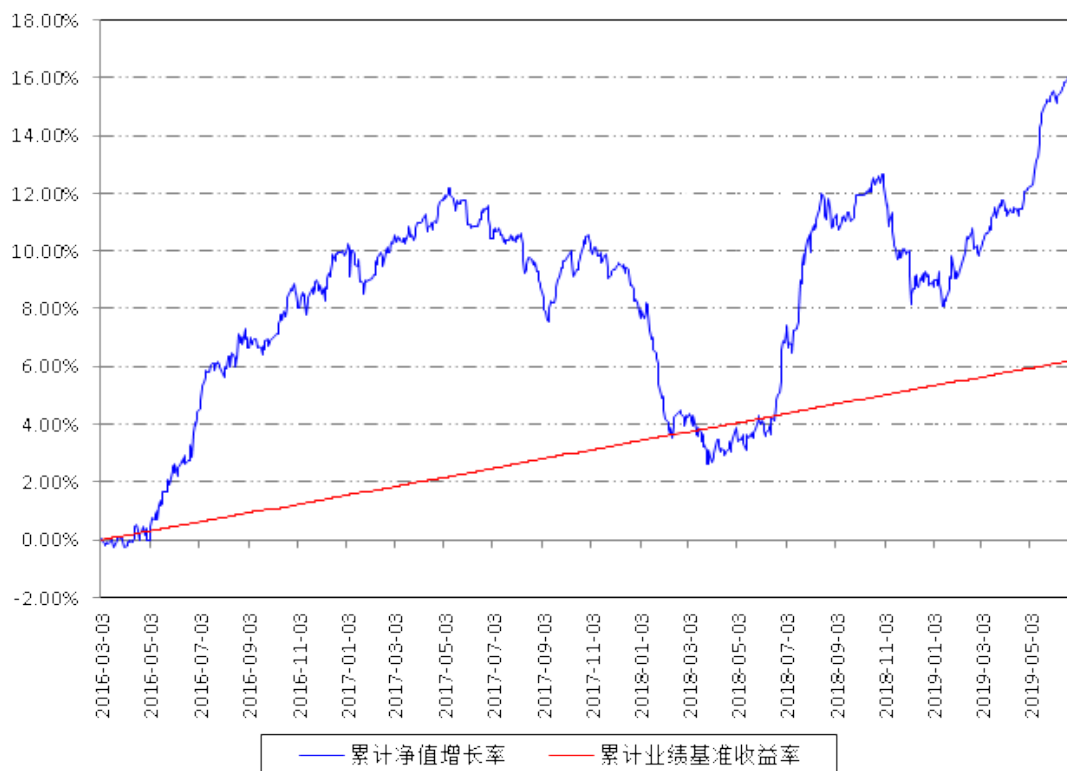
月						
过去一年	9.04%	0.25%	1.82%	0.00%	7.22%	0.25%
过去三年	11.88%	0.23%	5.34%	0.00%	6.54%	0.23%
自基金合同生效起至今	16.53%	0.23%	6.25%	0.00%	10.28%	0.23%

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

南方亚洲美元债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



南方亚洲美元债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



§ 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。

2018年1月,公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019年7月,根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议,并经中国证监会核准,本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本,认购完成后注册资本为36172万元人民币。目前股权结构为:华泰证券股份有限公司41.16%、深圳市投资控股有限公司27.44%、厦门国际信托有限公司13.72%、兴业证券股份有限公司9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)2.20%。目前,公司在北京、上海、合肥、成都、深圳、南京等地设有分公司,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，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 8800 亿元，旗下管理 191 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职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		
苏炫纲	本基金基金经理	2016年3月3日	-	17年	台湾籍，美国印第安纳大学工商管理硕士，特许金融分析师（CFA），特许会计师（CPA），金融风险管理师（FRM），具有基金从业资格。11年海外证券市场工作经验，曾任职于台湾大众银行、台湾美国商业银行、美国Citadel Investment Group、台湾大华证券、台湾凯基证券，历任产品设计师、固定收益产品分析师、外汇与固定收益商品风险管理师、信用商品交易员等。2014年3月加入南方基金，担任国际业务部基金经理助理；2016年3月至今，任南方亚洲美元债基金经理。

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 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。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

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或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

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5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 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

2019年上半年，海外债市整体出现估值修复，主要受益于去年年末融资环境改善、城投政策转向、市场对基建、地产托底经济的预期，高收益标的尤其是房地产和城投板块表现较好；二季度由于政策预期转向（4月政治局会议），房地产板块出现小幅调整，分化逐渐显著，但季末受益于市场对于G20峰会较为乐观的预期，市场情绪开始逐步恢复。全球经济增速则依然偏弱，叠加美联储6月FOMC会议鸽派表态，美债收益率继续回落，长期美债利率一度下行突破2%。

美联储6月FOMC会议并未加息，市场反应偏鸽派，从美联储官员表态来看，认为年内不降息和降息50个基点的人数几乎相同，同时认为今年不加息的官员均认为明年才会出现50个基点的降息。经济预测方面，考虑到美国经济数据继续走弱的事实，在声明中着重强调了核心CPI已经小于2%，市场通胀指标也已经开始下降，并强调经济预期的不确定性明显增加。从政策表态看，考虑到前期中美贸易战的扰动，美联储官员的表态并没有市场预期中的鸽派，市场对于年末降息的预期逐渐出现分歧。欧央行政策态度继续维持鸽派，德拉吉表示如果欧元区经济增速和通胀疲软无法有效改善，不排除欧央行下半年会采取进一步宽松的刺激政策。

基金的操作上，南方亚洲美元债报告期内继续保持稳健的投资风格，即使高收益债市出现调整，且依然面临境内债市信用风险的扰动，美元债基金整体运作继续保持平稳，并继续增加对部分优质标的的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.1846 元，报告期内，份额净值增长率为 7.26%，同期业绩基准增长率为 0.87%；本基金 C 份额净值为 1.1653 元，报告期内，份额净值增长率为 7.00%，同期业绩基准增长率为 0.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，预计 2019 年下半年市场不确定性仍然较高，受到包括贸易战、英国政局、全球经济下行、新兴市场动荡等扰动因素，这些都会影响宏观经济和汇率走势。随着全球经济继续走弱，市场对于通胀的预期继续回落，叠加美债期限利差开始倒挂，美国经济领先指标继续走弱，美联储继 7 月开启降息周期之后，进一步降息的空间已经打开，市场对于年末和明年年初降息的预期逐渐升温，市场环境整体都会有利于债市的表现，也对固定收益产品继续提供有利支撑。利率债和多数投资级标的预计继续受益于美债基准利率的下行，城投板块依然受益于偏宽松的政策，再融资渠道通畅，考虑到部分资质较弱平台依然存在非标、信托风险事件，依然保持谨慎的态度；而地产板块经过年初至今的估值修复和调整，优质标的目前价格依然相对偏贵，考虑到上半年中资高收益民企的信用风险事件依旧频发，债市风险偏好并未显著提升，叠加地产融资渠道的政策收紧，信用端的全面改善仍然需要时间。因此 2019 年下半年债市操作保持谨慎乐观。

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企业会计准则、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。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。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；基金收益分配币种与其对应份额的认购/申购币种相同；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；美元认购/申购份额的红利再投资按所对应的美元折算净值为基准计算；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人民币基金份额净值减去每单位该类别基金份额收益分配金额后不能低于人民币份额面值，但对于美元份额，由于汇率因素影响，存在收益分配后美元份额的基金份额净值低于对应的基金份额面值的可能；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份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 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，本基金托管人在对南方亚洲美元收益债券型基金（QDII）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全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

本报告期内，南方亚洲美元收益债券型基金（QDII）的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方亚洲美元收益债券型基金（QDII）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方亚洲美元收益债券型基金（QDII）未进行利润分配。

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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方亚洲美元收益债券型基金（QDII）2019年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：南方亚洲美元收益债券型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	112,885,469.00	134,262,032.74
结算备付金		-	-
存出保证金		44,157,579.63	31,789,088.91
交易性金融资产	6.4.4.2	1,376,069,783.70	1,572,999,501.18
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	22,648,560.00
债券投资		1,376,069,783.70	1,550,350,941.18
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		-	18,813,381.40
应收利息	6.4.4.5	25,954,543.76	18,867,346.48
应收股利		-	205,840.20
应收申购款		4,185,422.71	113,790.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		1,563,252,798.80	1,777,050,981.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日

负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		14,241,412.31	17,528,759.38
应付管理人报酬		1,023,253.26	1,219,127.42
应付托管费		281,394.68	335,260.04
应付销售服务费		176,381.03	201,423.54
应付交易费用	6.4.4.7	-	-
应交税费		238,449.79	248,687.85
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	117,498.30	693,562.69
负债合计		16,078,389.37	20,226,820.92
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	1,312,252,966.29	1,596,963,814.28
未分配利润	6.4.4.10	234,921,443.14	159,860,345.88
所有者权益合计		1,547,174,409.43	1,756,824,160.16
负债和所有者权益总计		1,563,252,798.80	1,777,050,981.08

注：报告截止日2019年6月30日，南方亚洲美元债A份额净值1.1846元，基金份额总额954,330,044.15份；南方亚洲美元债C份额净值1.1653元，基金份额总额357,922,922.14份；总份额合计1,312,252,966.29份。

6.2 利润表

会计主体：南方亚洲美元收益债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年1月1日至2018年6月30日

一、收入		120,331,847.74	-43,455,983.78
1. 利息收入		42,670,400.80	63,107,482.55
其中：存款利息收入	6.4.4.11	352,310.48	335,601.03
债券利息收入		42,318,090.32	63,246,047.03
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	99,113.64
其他利息收入		-	-573,279.15
2. 投资收益（损失以“-”填列）		23,866,233.91	-121,728,433.85
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-	-
基金投资收益	6.4.4.13	-1,292,122.33	-7,542,391.07
债券投资收益		20,056,163.82	-132,849,012.26
资产支持证券投资	6.4.4.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.4.16	-	-
衍生工具收益	6.4.4.17	4,408,013.92	18,088,439.71
股利收益	6.4.4.18	694,178.50	574,529.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.19	40,872,363.42	10,163,221.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		12,849,833.81	4,797,211.87
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.20	73,015.80	204,534.18
减：二、费用		9,841,604.29	17,706,213.04
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	6,404,270.82	11,123,423.66
2. 托管费	6.4.7.2.2	1,761,174.53	3,058,941.49
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	1,082,532.58	1,818,256.86
4. 交易费用	6.4.4.21	298,794.85	1,195,394.62
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 税金及附加		182,483.82	296,479.33
7. 其他费用	6.4.4.22	112,347.69	213,717.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		110,490,243.45	-61,162,196.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		110,490,243.45	-61,162,196.82

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方亚洲美元收益债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,596,963,814.28	159,860,345.88	1,756,824,160.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	110,490,243.45	110,490,243.45
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）	-284,710,847.99	-35,429,146.19	-320,139,994.18
其中：1. 基金申购款	186,204,127.86	27,236,902.53	213,441,030.39
2. 基金赎回款	-470,914,975.85	-62,666,048.72	-533,581,024.57
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）	1,312,252,966.29	234,921,443.14	1,547,174,409.43

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	3,110,262,751.10	277,875,710.70	3,388,138,461.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-61,336,585.56	-61,336,585.56
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)	-875,702,710.20	-43,152,834.30	-918,855,544.50
其中：1. 基金申购款	197,383,956.78	11,619,321.34	209,003,278.12
2. 基金赎回款	-1,073,086,666.98	-54,772,155.64	-1,127,858,822.62
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)	2,234,560,040.90	173,386,290.84	2,407,946,331.74

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 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。

6.4.3 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[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：

(a) 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[适用于有国债、地方政府债类境内投资的QDII基金]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。

(b) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(c) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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。

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	112,885,469.00
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-

合计	112,885,469.00
----	----------------

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 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	1,317,016,866.29	1,376,069,783.70	59,052,917.41
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,317,016,866.29	1,376,069,783.70	59,052,917.41
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,317,016,866.29	1,376,069,783.70	59,052,917.41	

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-530,652,000.64	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-530,652,000.64	-	-	-

衍生金融资产项下的期货投资净额为 1,612,011.37 元

6.4.4.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	8,349.53
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	25,946,194.23

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	25,954,543.76

6.4.4.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.4.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,552.50
预提费用	111,945.80
其他	-
合计	117,498.30

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

南方亚洲美元债 A		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,169,850,926.27	1,169,850,926.27
本期申购	78,410,692.36	78,410,692.36
本期赎回（以“-”号填列）	-293,931,574.48	-293,931,574.48
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	954,330,044.15	954,330,044.15

金额单位：人民币元

南方亚洲美元债 C		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	427,112,888.01	427,112,888.01
本期申购	107,793,435.50	107,793,435.50

本期赎回（以“-”号填列）	-176,983,401.37	-176,983,401.37
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	357,922,922.14	357,922,922.14

本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

南方亚洲美元债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	56,771,085.93	65,035,179.22	121,806,265.15
本期利润	51,590,561.72	29,345,746.57	80,936,308.29
本期基金份额交易产生的变动数	-15,580,047.36	-11,388,353.52	-26,968,400.88
其中：基金申购款	6,639,219.15	5,385,362.29	12,024,581.44
基金赎回款	-22,219,266.51	-16,773,715.81	-38,992,982.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	92,781,600.29	82,992,572.27	175,774,172.56

单位：人民币元

南方亚洲美元债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,417,111.35	23,636,969.38	38,054,080.73
本期利润	18,027,318.31	11,526,616.85	29,553,935.16
本期基金份额交易产生的变动数	-4,158,000.79	-4,302,744.52	-8,460,745.31
其中：基金申购款	7,622,817.16	7,589,503.93	15,212,321.09
基金赎回款	-11,780,817.95	-11,892,248.45	-23,673,066.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,286,428.87	30,860,841.71	59,147,270.58

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	351,898.14
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	412.34
合计	352,310.48

6.4.4.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.4.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	67,407,948.49
减：卖出/赎回基金成本总额	68,700,070.82
基金投资收益	-1,292,122.33

6.4.4.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,286,449,789.54
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,246,098,292.27
减：应收利息总额	20,295,333.45
买卖债券差价收入	20,056,163.82

6.4.4.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.4.16 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.4.17 衍生工具收益**6.4.4.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.4.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
外汇期货-投资收益	4,408,013.92

6.4.4.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	-
基金投资产生的股利收益	694,178.50

合计	694,178.50
----	------------

6.4.4.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	39,847,943.41
——股票投资	-
——债券投资	40,016,880.08
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-168,936.67
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	1,024,420.01
——权证投资	-
期货	1,024,420.01
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	40,872,363.42

6.4.4.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
其他	73,015.80
合计	73,015.80

1、本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，赎回费总额按一定比例归入基金资产。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额按一定比例归入转出基金的基金资产。

6.4.4.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	298,794.85
银行间市场交易费用	-
合计	298,794.85

6.4.4.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	49,092.63

信息披露费	62,853.17
银行费用	401.89
合计	112,347.69

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司新增厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）四名股东，股权结构发生变更。基金管理人已于2019年8月1日发布相关公告。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
美国北美信托银行有限公司(“北美信托银行”)	境外资产托管人
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
兴业证券股份有限公司	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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2019年1月1日至 2019年6月30日	上年度可比期间2018年 1月1日至2018年6月 30日

当期发生的基金应支付的管理费	6,404,270.82	11,123,423.66
其中：支付销售机构的客户维护费	1,325,271.51	3,895,159.14

注：支付基金管理人南方基金管理股份有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.80%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,761,174.53	3,058,941.49

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.22%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

6.4.7.2.3 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方亚洲美元债 A	南方亚洲美元债 C	合计
工商银行	-	20,029.42	20,029.42
华泰证券	-	1,592.06	1,592.06
南方基金	-	11,256.22	11,256.22
兴业证券	-	207.82	207.82
合计	-	33,085.52	33,085.52
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方亚洲美元债 A	南方亚洲美元债 C	合计
南方基金	-	106,004.04	106,004.04
工商银行	-	434,855.14	434,855.14
华泰证券	-	49,531.09	49,531.09
兴业证券	-	895.65	895.65
合计	-	591,285.92	591,285.92

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

0.50%的年费率计提，每日计提，按月支付。由本基金的基金管理人南方基金向本基金的基金托管人中国工商银行发送划付指令，经中国工商银行复核后从基金财产中一次性支付给各销售机构。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 0.50%/ 当年天数。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.7.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	南方亚洲美元债 A			
	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业证券股份有限公司	50,017,472.22	14.3323%	50,017,472.22	11.1900%

注：报告期末基金份额占比为持有该类别基金份额数占该类别基金份额总额的比例。兴业证券投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.7.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
北美信托银行	75,454,892.93	277,498.88	41,188,867.64	99,433.48
中国工商银行	37,430,576.07	74,399.26	250,804,532.12	230,870.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人北美信托银行保管的银行存款，按适用约定利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内其他关联交易事项。

6.4.8 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.9 期末（2019年06月30日）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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无因债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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，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。

6.4.10.2 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工商银行及境外资产托管人北美信托银行，与银行存款相

关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于2019年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为85.12%(2018年12月31日：88.25%)。

6.4.10.3 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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在OTC市场交易，因此均能以合理价格适时变现。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。

于2019年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

6.4.10.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金本报告期末无金融资产和金融负债的到期期限分析。

6.4.10.3.2 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期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公司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上述比例限制）。

本基金所持大部分证券在OTC市场交易，因此均能以合理价格适时变现。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。

注：流动性受限资产、7个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.10.4 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。

6.4.10.4.1 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。

本基金主要投资于 OTC 市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	112,885,469.00	-	-	-	112,885,469.00
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	44,157,579.63	-	-	-	44,157,579.63
交易性金融资产	80,308,118.37	749,484,368.73	546,277,296.60	-	1,376,069,783.70
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	25,954,543.76	25,954,543.76
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	167,439.29	-	-	4,017,983.42	4,185,422.71
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	237,518,606.29	749,484,368.73	546,277,296.60	29,972,527.18	1,563,252,798.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,241,412.31	14,241,412.31
应付管理人报酬	-	-	-	1,023,253.26	1,023,253.26
应付托管费	-	-	-	281,394.68	281,394.68

应付证券清算款	-	-	-	1,612,011.37	1,612,011.37
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	176,381.03	176,381.03
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	238,449.79	238,449.79
其他负债	-	-	-	-1,494,513.07	-1,494,513.07
负债总计	-	-	-	16,078,389.37	16,078,389.37
利率敏感度缺口	237,518,606.29	749,484,368.73	546,277,296.60	13,894,137.81	1,547,174,409.43
上年度末 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	134,262,032.74	-	-	-	134,262,032.74
存出保证金	-	-	-	31,789,088.91	31,789,088.91
交易性金融资产	153,597,853.05	691,570,793.25	705,182,294.88	22,648,560.00	1,572,999,501.18
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	18,867,346.48	18,867,346.48
应收股利	-	-	-	205,840.20	205,840.20
应收申购款	7,627.08	-	-	106,163.09	113,790.17
应收证券清算款	-	-	-	18,813,381.40	18,813,381.40
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	287,867,512.87	691,570,793.25	705,182,294.88	92,430,380.08	1,777,050,981.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,528,759.38	17,528,759.38
应付管理人报酬	-	-	-	1,219,127.42	1,219,127.42
应付托管费	-	-	-	335,260.04	335,260.04

应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	201,423.54	201,423.54
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	248,687.85	248,687.85
其他负债	-	-	-	693,562.69	693,562.69
负债总计	-	-	-	20,226,820.92	20,226,820.92
利率敏感度缺口	287,867,512.87	691,570,793.25	705,182,294.88	72,203,559.16	1,756,824,160.16

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。

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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(2019年6月30日)	上年度末(2018年12月31日)
	1.市场利率平行上升25个基点	-10,417,564.79	-10,849,780.48
2.市场利率平行下降25个基点	10,554,005.27	10,851,208.45	

6.4.10.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债,因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.10.4.2.1 外汇风险敞口

单位:人民币元

项目	本期末2019年6月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	67,547,753.48	21,437,800.45	-	88,985,553.93

存出保证金	44,157,579.63	-	-	44,157,579.63
交易性金融资产	1,353,109,426.18	22,960,357.52	-	1,376,069,783.70
应收申购款	1,186,145.07	-	-	1,186,145.07
应收利息	25,946,425.08	-	-	25,946,425.08
资产合计	1,491,947,329.44	44,398,157.97	-	1,536,345,487.41
以外币计价的负债				
应付证券清算款	1,612,011.37	-	-	1,612,011.37
负债合计	1,612,011.37	-	-	1,612,011.37
资产负债表外汇风险敞口净额	1,490,335,318.07	44,398,157.97	-	1,534,733,476.04

单位：人民币元

项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	128,662,373.54	4,085,219.21	-	132,747,592.75
存出保证金	31,789,088.91	-	-	31,789,088.91
交易性金融资产	1,425,636,502.59	34,944,345.54	-	1,460,580,848.13
应收股利	205,840.20	-	-	205,840.20
应收利息	16,966,554.80	637,709.31	-	17,604,264.11
应收申购款	68,768.17	-	-	68,768.17
应收证券清算款	18,813,381.40	-	-	18,813,381.40
其它资产	-	-	-	-
银行存款	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	1,622,142,509.61	39,667,274.06	-	1,661,809,783.67
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	7,506,848.88	-	-	7,506,848.88
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	619.06	-	-	619.06

应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	7,507,467.94	-	-	7,507,467.94
资产负债表外汇 风险敞口净额	1,614,635,041.67	39,667,274.06	-	1,654,302,315.73

6.4.10.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外汇风险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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	76,736,673.80	82,715,115.79
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-76,736,673.80	-82,715,115.79	

6.4.10.4.3 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，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。本基金投资于债券比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于亚洲市场美元债券的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金不投资普通股票和权证等。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,包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

单位:人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	22,648,560.00	1.29
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	-	-	22,648,560.00	1.29

注:其他包含股指/商品/国债/外汇期货投资,于 2019 年 6 月 30 日,持仓数量为-770 手,合约市值为-530,652,000.64 元(附注 6.4.4.3)。在当日无负债结算制度下,结算准备金已包括所持股指/商品/国债/外汇期货投资产生的持仓损益,则其他中包含的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无其他价格风险的敏感性分析。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	1,376,069,783.70	88.03
	其中：债券	1,376,069,783.70	88.03
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付 金合计	112,885,469.00	7.22
8	其他资产	74,297,546.10	4.75
9	合计	1,563,252,798.80	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有股票。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 名的权益投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
A+ 至 A-	108,862,593.18	7.04

BBB+ 至 BBB-	273,722,665.41	17.69
BB+ 至 BB-	595,156,445.49	38.47
B+ 至 B-	364,850,668.55	23.58
其他	33,477,411.07	2.16
合计	1,376,069,783.70	88.94

注：本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息，未提供评级信息的可适用内部评级。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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（张）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	XS1681539539	STOAU 4 1/8 09/14/27	151,800	102,913,632.03	6.65
2	XS1496760239	CCAMCL 4.45 12/29/49 CORP	130,000	88,047,514.01	5.69
3	XS1932902486	GZRFPR 8 3/4 01/10/20	120,000	86,217,812.60	5.57
4	XS1860402954	CHFOTN 9 07/31/21	100,000	71,980,171.41	4.65
5	XS1422790615	HRINTH 4 5/8 06/03/26	100,000	71,316,075.39	4.61

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	外汇期货	XUCU9 Curncy	1,612,011.37	0.10

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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

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。

7.10.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	44,157,579.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,954,543.76
5	应收申购款	4,185,422.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	74,297,546.10

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 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
南方亚洲	26,483		53,325,564.38	5.59%	901,004,479.77	94.41%

美元债 A		36,035.57				
南方亚洲美元债 C	19,058	18,780.72	722,691.47	0.20%	357,200,230.67	99.80%
合计	45,541	28,814.76	54,048,255.85	4.12%	1,258,204,710.44	95.88%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，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	南方亚洲美元债 A	3,289,176.31	0.9412%
	南方亚洲美元债 C	22,656.20	0.0211%
	合计	3,311,832.51	0.2524%

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	南方亚洲美元债 A	0
	南方亚洲美元债 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方亚洲美元债 A	10~50
	南方亚洲美元债 C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方亚洲美元债 A	南方亚洲美元债 C
基金合同生效日(2016年3月03日)基金份额总额	959,440,960.16	98,092,573.03
本报告期期初基金份额总额	1,169,850,926.27	427,112,888.01
本报告期基金总申购份额	39,205,346.18	53,896,717.75
减：报告期基金总赎回份额	146,965,787.24	88,491,700.69
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填）	-	-

列)		
本报告期末基金份额总额	954,330,044.15	357,922,922.14

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，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	
华泰证券	1	-	-	-	-	-

银河证券	1	-	-	-	-	-
Barclays Bank	1	-	-	-	-	-
BNP Paribas Corporate & Investment Banking	1	-	-	-	-	-
BANK OF CHINA HONG KONG BRANCH	1	-	-	-	-	-
Credit Agricole	1	-	-	-	-	-
CITI Group Global Markets Asia Limited	1	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	1	-	-	67,351.20	100.00%	-
Credit Suisse(Hong Kong) Limited	1	-	-	-	-	-
CITIC Securities International Company Limited	1	-	-	-	-	-
星展唯高达香港	1	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-

(Asia)L.L. C						
Guotai Junan (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporatio n Limited	-	-	-	-	-	-
Haitong Internation al Securities Co.,Ltd	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific)Li mited	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch (A sia Pacific) Ltd	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Ltd	-	-	-	-	-	-
Nomura (H ong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
SC Lowy	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered	-	-	-	-	-	-

Bank (Hong Kong) Ltd						
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-

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
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Barclays Bank	153,901,259.88	7.48%	-	-	-	-	-	-
BNP	141,395,247.13	6.87%	-	-	-	-	-	-

Paribas Corporate & Investmen t Banking									
BANK OF CHINA HONG KONG BRANCH	1,719,548.84	0.08%	-	-	-	-	-	-	-
Credit Agricole	6,733,662.50	0.33%	-	-	-	-	-	-	-
CITI Group Global Markets Asia Limited	176,736,587.15	8.59%	-	-	-	-	-	-	-
China Internatio nal Capital Corporati on Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	113,628,395.98	100.0 0%	
Credit Suisse(Ho ng Kong) Limited	16,512,754.00	0.80%	-	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities Internatio nal Company Limited	176,822,374.01	8.59%	-	-	-	-	-	-	-
星展唯高 达香港	20,843,244.00	1.01%	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia)L.L. C	115,063,678.50	5.59%	-	-	-	-	-	-	-

Guotai Junan (Hong Kong) Limited	47,414,872.26	2.30%	-	-	-	-	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	159,710,819.83	7.76%	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Co.,Ltd	101,545,552.88	4.93%	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific)Limited	98,697,212.22	4.80%	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch (Asia Pacific) Ltd	73,185,676.99	3.56%	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Asia Limited	98,896,787.76	4.81%	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Ltd	44,702,920.80	2.17%	-	-	-	-	-	-
Nomura (Hong Kong) Limited	277,587,415.01	13.49%	-	-	-	-	-	-
SC Lowy	122,188,526.41	5.94%	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered Bank	71,332,800.44	3.47%	-	-	-	-	-	-

(Hong Kong) Ltd								
UBS Securities Asia Limited	153,133,678.50	7.44%	-	-	-	-	-	-

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。

10.8 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	南方基金关于旗下部分基金增加阳光人寿为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-01-03
2	南方基金关于旗下部分基金增加腾安基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-01-08
3	南方基金关于旗下部分基金增加红塔证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-01-29
4	南方基金关于旗下部分基金增加腾安基金为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-02-20
5	南方基金关于旗下部分基金增加兴业银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-03-04
6	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机	中国证券报	2019-04-01

	银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告		
7	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报	2019-04-02
8	南方基金关于旗下部分基金增加基煜基金为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-04-24
9	南方基金关于旗下部分基金增加日照银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-05-29
10	南方基金关于旗下部分基金增加汇林保大为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-06-06
11	南方基金管理股份有限公司关于浙江金观诚基金销售有限公司暂停部分业务的公告	中国证券报	2019-06-25
12	南方基金管理股份有限公司关于深圳富济基金销售有限公司暂停部分业务的公告	中国证券报	2019-06-25
13	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	中国证券报	2019-06-25
14	南方基金关于开展机构及企业网上交易部分基金赎回费率优惠活动的公告	中国证券报	2019-06-26
15	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金定投申购费率优惠标准的公告	中国证券报	2019-06-27
16	南方基金管理股份有限公司关于中信建投期货有限公司暂停部分业务的公告	中国证券报	2019-06-28
17	南方基金管理股份有限公司关于北京加和基金销售有限公司暂停部分业务的公告	中国证券报	2019-06-28

§ 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

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方亚洲美元收益债券型证券投资基金的文件；
- 2、《南方亚洲美元收益债券型证券投资基金基金合同》；

- 3、《南方亚洲美元收益债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方亚洲美元收益债券型证券投资基金 2019 年半年度报告》原文。

12.2 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。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>