

南方养老目标日期 2035 三年持有期混合 型基金中基金 (FOF) 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

送出日期：2019 年 08 月 23 日

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。

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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48

7.8	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.....	48
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.....	48
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12	本报告期投资基金情况.....	49
7.13	投资组合报告附注.....	52
§ 8	基金份额持有人信息.....	53
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	54
§ 9	开放式基金份额变动.....	54
§ 10	重大事件揭示.....	55
10.1	基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4	基金投资策略的改变.....	55
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	55
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.9	其他重大事件.....	56
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§ 12	备查文件目录.....	57
12.1	备查文件目录.....	57
12.2	存放地点.....	58
12.3	查阅方式.....	58

基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)	
基金简称	南方养老目标日期 2035 (FOF)	
基金主代码	006290	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 6 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	
报告期末基金份额总额	451,046,830.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方养老目标日期 2035 (FOF) A	南方养老目标日期 2035 (FOF) C
下属分级基金的交易代码	006290	006291
报告期末下属分级基金的 份额总额	393,250,080.43 份	57,796,750.39 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“南方养老目标日期 2035 (FOF)”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金是采用目标日期策略的基金中基金,目标日期为 2035 年 12 月 31 日。本基金通过大类资产配置,投资于多种具有不同风险收益特征的基金,并随着目标日期的临近逐步降低本基金整体的风险收益水平,以寻求基金资产的长期稳健增值。目标日期到达后,本基金将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	本基金力争通过合理判断市场走势,合理配置基金、股票、债券等投资工具的比例,通过定量和定性相结合的方法精选具有不同风险收益特征的基金,力争实现基金资产的稳定回报。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准: $X * \text{沪深 300 指数收益率} + (100\% - X) * \text{上证国债指数收益率}$ (基金合同生效之日至 2023.12.31, $X=50\%$; 2024.1.1-2027.12.31, $X=40\%$; 2028.1.1-2031.12.31, $X=30\%$; 2032.1.1-2035.12.31, $X=20\%$; 2036.1.1 起, $X=15\%$;))
风险收益特征	本基金属于目标日期型基金中基金,2035 年 12 月 31 日为本基金的目标日期。从建仓期结束起至目标日期止,本基金的风险与收益水平将随着时间的流逝逐步降低。即本基金初始投资阶段的风险收益水平接近一般的混合型基金,随着目标日期的临近,本基金逐步发展为低风险混合型基金中基

	金。目标日期到达后，本基金相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小，但高于债券型基金和货币市场基金。
--	---

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	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
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
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 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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

2.5 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	南方养老目标日期 2035 (FOF) A	南方养老目标日期 2035 (FOF) C
本期已实现收益	10,595,092.09	1,469,513.52
本期利润	14,970,749.34	2,107,541.23
加权平均基金份额本期利润	0.0400	0.0378
本期加权平均净	3.89%	3.67%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	4.08%	3.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2019 年 06 月 30 日)	
期末可供分配利润	16,708,204.54	2,300,029.01
期末可供分配基金份额利润	0.0425	0.0398
期末基金资产净值	411,592,160.41	60,336,314.43
期末基金份额净值	1.0466	1.0439
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2019 年 06 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	4.66%	4.39%

注: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。

4、本基金 T 日的基金份额净值在所投资基金披露净值或万份收益的当日(法定节假日顺延至第一个交易日)计算,并于 T+3 日公告。

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

南方养老目标日期 2035 (FOF) 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	2.81%	0.54%	2.92%	0.59%	-0.11%	-0.05%
过去三个月	-0.34%	0.59%	-0.06%	0.77%	-0.28%	-0.18%

过去六个月	4.08%	0.48%	14.27%	0.78%	-10.19%	-0.30%
自基金合同	4.66%	0.41%	10.87%	0.73%	-6.21%	-0.32%

南方养老目标日期 2035 (FOF) C

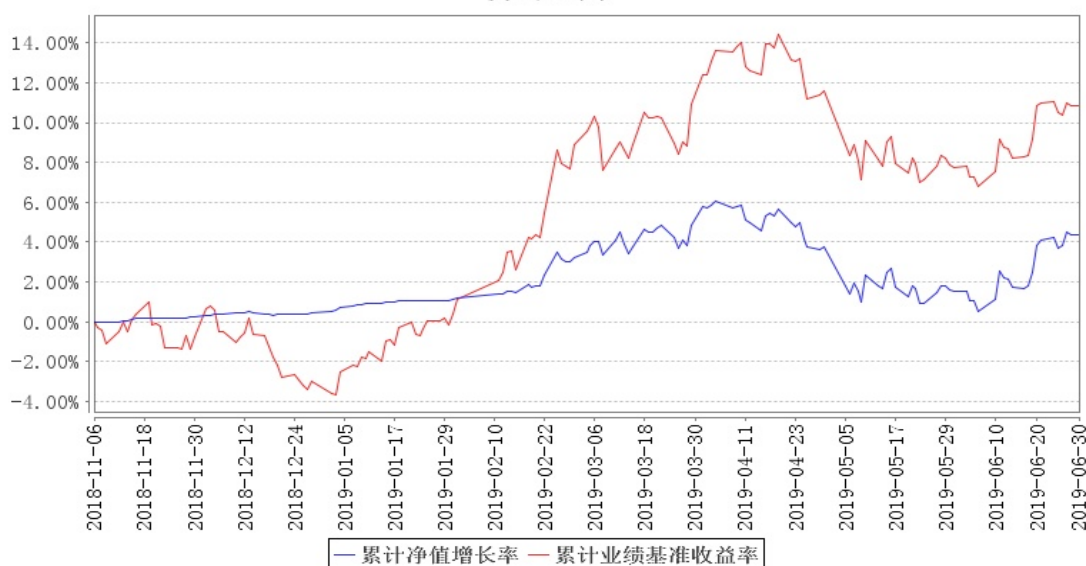
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	2.78%	0.54%	2.92%	0.59%	-0.14%	-0.05%
过去三个月	-0.45%	0.59%	-0.06%	0.77%	-0.39%	-0.18%
过去六个月	3.87%	0.48%	14.27%	0.78%	-10.40%	-0.30%
自基金合同	4.39%	0.41%	10.87%	0.73%	-6.48%	-0.32%

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

南方养老目标日期2035 (FOF) 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



南方养老目标日期2035 (FOF) 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：本基金合同于 2018 年 11 月 6 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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。

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		
黄俊	本基金基 金经理	2018 年 11 月 6 日	-	9	中国人民银行研究生部金融学硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于中国期货保证金监控中心、瀚信资产管理有限公司、深圳盈泰投资管理有限公司，2012 年 5 月加入南方基金，任研究部研究员，负责宏观、策略的研究；2015 年 2 月至 2015 年 11 月，任南方隆元、南方中国梦基金经理助理；2015 年 11 月至 2018 年 2 月，任南方消费活力基金经理；2018 年 11 月至今，任南方养老 2035 基金经理；2019 年 5 月至今，任南方富元稳健养老基金经理。
鲁炳良	本基金基 金经理	2018 年 12 月 21 日	-	7	上海财经大学经济学硕士，具有基金从业资格。曾就职于建设银行、申银万国证券研究所、中国平安人寿保险投资管理中心，历任产品经理、基金产品分析师、投资经理等。2018 年 6 月加入南方基金；

					2018 年 12 月至今， 任南方养老 2035 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

回顾 2019 年上半年, 受益于悲观预期的修正, 全球风险资产出现了明显的上升。国内权益市场更加明显, 随着持续的货币宽松、基建投资加码、减税降费及科创板改革利好的相继兑现, 投资者信心明显改善, 沪深 300 指数涨幅超过 25%。同时, 固收类资产在货币宽松背景下表现相

对平稳。

南方养老 2035FOF 已于 2018 年 11 月进行债券类基金的建仓，在今年上半年秉承价值投资和逆向投资理念，平稳建仓权益类资产，组合股债配置比例逐渐接近业绩比较基准。而在子基金层面，组合降低了短久期纯债基金的配置比例，增加了长期业绩稳健、风险控制能力较强的二级债基。股票基金则精选坚持价值投资、投资风格清晰、能长期战胜业绩基准的主动投资基金经理，尽量获取可能的超额收益。从实际运作效果分析，股票类和固收类资产均有正业绩贡献，子基金整体相对于对应基金指数有较明显的超额表现。

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 1.0466 元，报告期内，份额净值增长率为 4.08%，同期业绩基准增长率为 14.27%；本基金 C 份额净值为 1.0439 元，报告期内，份额净值增长率为 3.87%，同期业绩基准增长率为 14.27%。

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，全球经济面临下行风险。作为发达经济体的美国、欧洲经济都出现走弱趋势，国内宏观经济增长有一定下行压力但整体保持平稳，中美贸易谈判仍在进行中，货币政策会保持流动性合理充裕。考虑到目前估值水平，权益资产估值仍处于历史中位数以下，有较好的配置价值，重点关注其中的结构性机会。固定收益资产将出现分化，利率及高等级债券资产上涨行情没有完全结束。低等级信用债中长期的违约压力仍然存在，需要较高的选券和信用风险控制能力。大宗商品方面，全球货币政策宽松利多黄金。

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，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；同一类别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。在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内，本基金托管人在对南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 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，南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 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。本报告期内南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 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养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 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：南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)

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	6.4.7.1	1,294,106.07	478,476.77
结算备付金		3,844,617.04	4,753,632.28
存出保证金		52,163.51	3,717.76
交易性金融资产	6.4.7.2	462,160,295.09	265,420,062.18
其中：股票投资		65,588,149.99	-
基金投资		396,572,145.10	265,420,062.18
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	4,500,000.00	130,200,000.00
应收证券清算款		1,179.87	-
应收利息	6.4.7.5	1,832.91	135,779.05
应收股利		86.01	13,035.48
应收申购款		493,375.50	793,406.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	12,333.54	19,535.38
资产总计		472,359,989.54	401,817,645.35
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	365,982.87
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		232,795.35	161,809.45
应付托管费		42,262.27	39,214.88
应付销售服务费		19,424.92	17,699.79
应付交易费用	6.4.7.7	47,362.16	-530.90
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,670.00	-
负债合计		431,514.70	584,176.09
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	451,046,830.82	399,031,840.38
未分配利润	6.4.7.10	20,881,644.02	2,201,628.88
所有者权益合计		471,928,474.84	401,233,469.26
负债和所有者权益总计		472,359,989.54	401,817,645.35

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，南方养老目标日期 2035 (FOF) A 份额净值 1.0466 元，基金份额总额 393,250,080.43 份；南方养老目标日期 2035 (FOF) C 份额净值 1.0439 元，基金份额总额 57,796,750.39 份；总份额合计 451,046,830.82 份。

6.2 利润表

会计主体：南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)

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
一、收入		18,741,627.85
1. 利息收入		906,648.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	55,927.80
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		850,720.25
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,736,455.61
其中：股票投资收益	6.4.7.12	47,570.82
基金投资收益	6.4.7.13	6,886,600.56
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资	6.4.7.14.1	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	5,802,284.23
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	5,013,684.96
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.19	84,839.23
减：二、费用		1,663,337.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,120,518.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	233,189.04
3. 销售服务费		113,633.45

4. 交易费用	6.4.7.20	81,429.74
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		18,180.99
7. 其他费用	6.4.7.21	96,385.20
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		17,078,290.57
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,078,290.57

注：-

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)

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)	399,031,840.38	2,201,628.88	401,233,469.26
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	17,078,290.57	17,078,290.57
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)	52,014,990.44	1,601,724.57	53,616,715.01
其中：1. 基金申购款	52,014,990.44	1,601,724.57	53,616,715.01
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)	451,046,830.82	20,881,644.02	471,928,474.84

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

南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)(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[2018]1245 号《关于准予南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)注册的批复》核准,由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)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 380,297,020.34 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(2018)第 0711 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》于 2018 年 11 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 380,359,017.67 份基金份额,其中认购资金利息折合 61,997.33 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金每份基金份额的锁定期指从基金合同生效日或基金份额申购申请日起至基金合同生效日或基金份额申购申请日次三年的年度对日的前一日(不含对日)。在锁定期内,基金份额持有人不能提出赎回申请,锁定期届满后的下一个工作日起可以提出赎回申请,若基金份额申购申请日至目标日期不满一个锁定期,目标日期到达后可以提出赎回申请。目标日期到达后即 2036 年 1 月 1 日起,本基金名称变更为“南方安智混合型基金中基金(FOF)”,本基金不再设置每份基金份额的锁定期。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用、不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 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 类基金份额将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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》的有关规定, 本基金投资于依法发行或上市的基金、股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括: 经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额(含 QDII、香港互认基金)、股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及沪港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票及深港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票)、权证、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、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、中小企业私募债及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为: 80%以上基金资产投资于其他经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额(含 QDII、香港互认基金); 投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)等品种的比例合计不超过基金资产的 60%; 投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%; 基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的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。本基金阶段性的资产配置如下表所示:

时间段	权益类资产(包括股票、股票型基金、混合型基金)比例	中枢值
基金合同生效之日至 2023 年 12 月 31 日	35%-60%	50%
2024 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日	25%-50%	40%
2028 年 1 月 1 日至 2031 年 12 月 31 日	15%-40%	30%
2032 年 1 月 1 日至 2035 年 12 月 31 日	5%-30%	20%
2036 年 1 月 1 日起	0-30%	15%

本基金的业绩比较基准如下表所示:

时间段	业绩比较基准
基金合同生效之日至 2023 年 12 月 31 日	沪深 300 指数收益率× 50%+上证国债指数收益率× 50%
2024 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日	沪深 300 指数收益率× 40%+上证国债指数收益率× 60%
2028 年 1 月 1 日至 2031 年 12 月 31 日	沪深 300 指数收益率× 30%+上证国债指数收益率× 70%
2032 年 1 月 1 日至 2035 年 12 月 31 日	沪深 300 指数收益率× 20%+上证国债指数收益率× 80%

2036 年 1 月 1 日起	沪深 300 指数收益率× 15%+上证国债指数收益率 × 85%
-----------------	--------------------------------------

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<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》、《南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日和 2018 年 11 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 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 2019 年 6 月 30 日和 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日和 2018 年 11 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 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。

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。本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日和 2018 年 11 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日。

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、基金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。

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、基金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。

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。

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。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。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。

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。

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、基金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[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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 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) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引(试行)〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》，按采用如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金(LOF)及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份(百份)收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

(a) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。

(b) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基

金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。

(c) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

(4) 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。

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	1,294,106.07
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 个月及以上	-
其他存款	-
合计	1,294,106.07

6.4.7.2 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	62,481,217.03	65,588,149.99	3,106,932.96
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	398,175,493.65	396,572,145.10	-1,603,348.55
其他	-	-	-
合计	460,656,710.68	462,160,295.09	1,503,584.41

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2019 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	4,500,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 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	254.76
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	1,557.00
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	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	21.15
合计	1,832.91

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
其他应收款	12,333.54
待摊费用	-
合计	12,333.54

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	47,362.16
银行间市场应付交易费用	-
合计	47,362.16

6.4.7.8 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	-
预提费用	89,670.00
合计	89,670.00

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

南方养老目标日期 2035 (FOF) 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	346,538,394.69	346,538,394.69
本期申购	46,711,685.74	46,711,685.74
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	393,250,080.43	393,250,080.43

南方养老目标日期 2035 (FOF) 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	52,493,445.69	52,493,445.69
本期申购	5,303,304.70	5,303,304.70
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	57,796,750.39	57,796,750.39

注: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。

6.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

南方养老目标日期 2035 (FOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,966,977.75	-3,027,382.29	1,939,595.46
本期利润	10,595,092.09	4,375,657.25	14,970,749.34
本期基金份额 交易产生的变动数	1,146,134.70	285,600.48	1,431,735.18
其中:基金申 购款	1,146,134.70	285,600.48	1,431,735.18
基金赎 回款	-	-	-
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	16,708,204.54	1,633,875.44	18,342,079.98

南方养老目标日期 2035 (FOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	720,360.14	-458,326.72	262,033.42
本期利润	1,469,513.52	638,027.71	2,107,541.23
本期基金份额 交易产生的变 动数	110,155.35	59,834.04	169,989.39
其中：基金申 购款	110,155.35	59,834.04	169,989.39
基金赎 回款	-	-	-
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	2,300,029.01	239,535.03	2,539,564.04

6.4.7.11 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	18,176.75
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	37,210.54
其他	540.51
合计	55,927.80

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	105,780.51
减：卖出股票成本总额	58,209.69
买卖股票差价收入	47,570.82

6.4.7.13 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	235,348,121.39
减：卖出/赎回基金成本总额	228,461,520.83
基金投资收益	6,886,600.56

6.4.7.14 债券投资收益

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

注:本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注:本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

注:本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 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	548,491.32
基金投资产生的股利收益	5,253,792.91
合计	5,802,284.23

6.4.7.18 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	5,013,684.96
股票投资	3,106,932.96
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	1,906,752.00
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	5,013,684.96

6.4.7.19 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	-
基金销售服务费返还收入	84,839.23
合计	84,839.23

6.4.7.20 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	62,429.74
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	19,000.00
其中：申购费	19,000.00
赎回费	-
合计	81,429.74

6.4.7.20.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用
	2019年1月1日至2019年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	125,468.01
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,188,857.74
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	275,004.89

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.21 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	29,752.78
信息披露费	59,917.22
账户维护费	4,500.00
银行费用	2,215.20
合计	96,385.20

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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、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
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(“兴业证券”)	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注:本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 基金交易

注:本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.3 权证交易

注:本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,120,518.86
其中:支付销售机构的客户维护费	178,851.22

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

×0.9%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:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.9%÷当年天数。

6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	233,189.04

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×0.15%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:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

6.4.10.2.3 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		
	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		
	南方养老目标日期 2035 (FOF) A	南方养老目标日期 2035 (FOF) C	合计
工商银行	-	1,557.87	1,557.87
华泰证券	-	7,798.84	7,798.84
南方基金	-	15,743.48	15,743.48
兴业证券	-	123.71	123.71
合计	-	25,223.90	25,223.90

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值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。其计

算公式为:

日销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 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银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:无。

6.4.10.4.2 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

注:无。

6.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,294,106.07	18,176.75

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,按银行约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

于2019年6月30日,本基金持有基金管理人南方基金所管理的公开募集证券投资基金合计150,764,250.01元(2018年12月31日:186,588,019.05元),占本基金资产净值的比例为31.95%(2018年12月31日:46.50%)。

6.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2019年1月1日至2019年6月30日
	当期交易基金产生的申购费(元)
当期交易基金产生的赎回费(元)	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	84,839.23
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	520,947.13
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	125,597.44

注:本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金(ETF除外),应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费(按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外)、销售服务费等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免,故当期交易基金

产生的申购费为 0，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2019 年 06 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为基金中基金，2035 年 12 月 31 日为本基金的目标日期。从建仓期结束起至目标日期止，本基金的风险与收益水平将逐步降低。即本基金初始投资阶段的风险收益水平接近一般的混合型基金，随着目标日期的临近，本基金逐步发展为低风险混合型基金中基金。目标日期到达后，本基金相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小，但高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资和债券投资等。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。本基金通过大类资产配置，投资于多种具有不同风险收益特征的基金，并随着目标日期的临近逐步降低本基金整体的风险收益水平，以寻求基金资产的长期稳健增值。目标日期到达后，本基金将在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。

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。

6.4.13.2 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人中国工商银行，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，在场外申赎基金份额均通过该基金的基金管理人的直销柜台办理，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。

本基金基于内部评价系统对基金管理公司及其管理基金的评级，将投资于管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的基金。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。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，本基金无债券投资(2018 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 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于锁定期届满后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自基金合同生效日满三年起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 2019 年 6 月 30 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。

6.4.13.3.1 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》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。

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金 (ETF 联接基金除外) 不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券 (不含本基金所投资的基金份额) 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 (不含本基金所投资的基金份额) 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)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在基金销售机构申购、赎回，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 6.4.12。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%。于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.01%。

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。

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。流通受限基金是指封闭运作基金、定期开放基金等由基金合同明确规定在一定期限锁定期内不可赎回的基金，但不包括 ETF、LOF 等可上市交易的基金。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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、存出保证金和买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 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	1,294,106.07	-	-	-	1,294,106.07
结算备付金	3,844,617.04	-	-	-	3,844,617.04
存出保证金	52,163.51	-	-	-	52,163.51
交易性金融资产	-	-	-	-462,160,295.09	462,160,295.09
买入返售金融资产	4,500,000.00	-	-	-	4,500,000.00
应收利息	-	-	-	1,832.91	1,832.91
应收股利	-	-	-	86.01	86.01
应收申购款	5,646.00	-	-	487,729.50	493,375.50
应收证券清算款	-	-	-	1,179.87	1,179.87
其他资产	-	-	-	12,333.54	12,333.54
资产总计	9,696,532.62	-	-	-462,663,456.92	472,359,989.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	232,795.35	232,795.35
应付托管费	-	-	-	42,262.27	42,262.27
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	19,424.92	19,424.92
应付交易费用	-	-	-	47,362.16	47,362.16
应付利息	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	89,670.00	89,670.00
负债总计	-	-	-	431,514.70	431,514.70
利率敏感度缺口	9,696,532.62	-	-	-462,231,942.22	471,928,474.84
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	478,476.77	-	-	-	478,476.77
结算备付金	4,753,632.28	-	-	-	4,753,632.28
存出保证金	3,717.76	-	-	-	3,717.76
交易性金融资产	-	-	-	-265,420,062.18	265,420,062.18
买入返售金融资产	130,200,000.00	-	-	-	130,200,000.00
应收利息	-	-	-	135,779.05	135,779.05
应收股利	-	-	-	13,035.48	13,035.48
应收申购款	-	-	-	793,406.45	793,406.45
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	19,535.38	19,535.38
资产总计	135,435,826.81	-	-	-266,381,818.54	401,817,645.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	161,809.45	161,809.45
应付托管费	-	-	-	39,214.88	39,214.88
应付证券清算款	-	-	-	365,982.87	365,982.87
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	17,699.79	17,699.79
应付交易费用	-	-	-	-530.90	-530.90
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	584,176.09	584,176.09
利率敏感度缺口	135,435,826.81	-	-	-265,797,642.45	401,233,469.26

注:表中所示为本基金资产及负债的公允价值,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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注:于2019年6月30日,本基金未持有交易性债券投资(2018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(2018年12月31日:同)。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、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，以宏观经济分析为重点，基于经济结构调整过程中相关政策与法规的变化、证券市场环境、金融市场利率变化、经济运行周期、投资者情绪以及证券市场不同类别资产的风险/收益状况等，判断宏观经济发展趋势、政策导向和证券市场的未来发展趋势，确定和构造合适的资产配置比例。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金 80%以上基金资产投资于其他经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额(含 QDII、香港互认基金)；其中投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)等品种的比例合计不超过基金资产的 60%；投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	65,588,149.99	13.90	—	—
交易性金融资产—基金投资	396,572,145.10	84.03	265,420,062.18	66.15
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	462,160,295.09	97.93	265,420,062.18	66.15

6.4.13.4.3.2 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（2019年6月30日）	
	1. 组合自身基准上升 5%	12,723,191.68	
	2. 组合自身基准下降 5%	-12,723,191.68	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	65,588,149.99	13.89
	其中：股票	65,588,149.99	13.89
2	基金投资	396,572,145.10	83.96
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	4,500,000.00	0.95
	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	5,138,723.11	1.09
8	其他各项资产	560,971.34	0.12
9	合计	472,359,989.54	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	54,723.00	0.01
B	采矿业	3,026,708.40	0.64
C	制造业	20,586,857.29	4.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,103,913.00	0.45
E	建筑业	2,723,169.00	0.58
F	批发和零售业	671,571.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	2,261,411.00	0.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,640,777.76	0.35
J	金融业	29,317,894.94	6.21
K	房地产业	2,277,487.60	0.48
L	租赁和商务服务业	686,385.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	78,012.00	0.02
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	159,240.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	65,588,149.99	13.90

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	601318	中国平安	90,900	8,054,649.00	1.71
2	600519	贵州茅台	4,100	4,034,400.00	0.85
3	600036	招商银行	79,200	2,849,616.00	0.60
4	601166	兴业银行	108,500	1,984,465.00	0.42
5	600030	中信证券	67,400	1,604,794.00	0.34
6	600887	伊利股份	47,700	1,593,657.00	0.34
7	600276	恒瑞医药	21,300	1,405,800.00	0.30
8	601328	交通银行	219,500	1,343,340.00	0.28
9	600016	民生银行	197,600	1,254,760.00	0.27
10	600000	浦发银行	95,700	1,117,776.00	0.24

11	601288	农业银行	297,000	1,069,200.00	0.23
12	601668	中国建筑	176,400	1,014,300.00	0.21
13	600837	海通证券	70,000	993,300.00	0.21
14	601601	中国太保	26,100	952,911.00	0.20
15	600900	长江电力	49,400	884,260.00	0.19
16	600104	上汽集团	29,900	762,450.00	0.16
17	600048	保利地产	59,600	760,496.00	0.16
18	601211	国泰君安	39,300	721,155.00	0.15
19	601169	北京银行	122,000	721,020.00	0.15
20	601766	中国中车	81,300	657,717.00	0.14
21	601888	中国国旅	7,400	656,010.00	0.14
22	600585	海螺水泥	15,300	634,950.00	0.13
23	600009	上海机场	7,400	619,972.00	0.13
24	601988	中国银行	164,600	615,604.00	0.13
25	603288	海天味业	5,700	598,500.00	0.13
26	600309	万华化学	13,900	594,781.00	0.13
27	600031	三一重工	43,600	570,288.00	0.12
28	601229	上海银行	46,400	549,840.00	0.12
29	600028	中国石化	98,900	540,983.00	0.11
30	600690	海尔智家	29,600	511,784.00	0.11
31	601818	光大银行	130,000	495,300.00	0.10
32	600050	中国联通	79,400	489,104.00	0.10
33	600340	华夏幸福	14,600	475,522.00	0.10
34	600019	宝钢股份	70,100	455,650.00	0.10
35	601857	中国石油	64,200	441,696.00	0.09
36	601989	中国重工	77,100	428,676.00	0.09
37	601012	隆基股份	18,500	427,535.00	0.09
38	601628	中国人寿	14,900	421,968.00	0.09
39	600999	招商证券	24,600	420,414.00	0.09
40	601939	建设银行	54,700	406,968.00	0.09
41	601390	中国中铁	61,800	402,936.00	0.09
42	601186	中国铁建	40,100	398,995.00	0.08
43	601009	南京银行	47,900	395,654.00	0.08
44	601336	新华保险	7,100	390,713.00	0.08
45	600919	江苏银行	53,300	386,958.00	0.08
46	600015	华夏银行	50,000	385,000.00	0.08
47	601006	大秦铁路	46,400	375,376.00	0.08
48	601899	紫金矿业	94,800	357,396.00	0.08
49	600352	浙江龙盛	21,900	345,363.00	0.07
50	601088	中国神华	16,100	328,118.00	0.07
51	600570	恒生电子	4,800	327,120.00	0.07
52	600958	东方证券	28,900	308,652.00	0.07

53	600741	华域汽车	14,000	302,400.00	0.06
54	601155	新城控股	7,500	298,575.00	0.06
55	600968	海油发展	82,688	293,542.40	0.06
56	601933	永辉超市	28,200	287,922.00	0.06
57	601225	陕西煤业	31,000	286,440.00	0.06
58	600660	福耀玻璃	12,500	284,125.00	0.06
59	600436	片仔癀	2,400	276,480.00	0.06
60	601669	中国电建	50,800	268,732.00	0.06
61	600406	国电南瑞	14,300	266,552.00	0.06
62	600588	用友网络	9,800	263,424.00	0.06
63	601111	中国国航	27,400	262,218.00	0.06
64	600886	国投电力	33,100	257,187.00	0.05
65	600703	三安光电	22,600	254,928.00	0.05
66	600795	国电电力	98,400	249,936.00	0.05
67	600010	包钢股份	143,100	241,839.00	0.05
68	600029	南方航空	30,300	233,916.00	0.05
69	600547	山东黄金	5,600	230,552.00	0.05
70	603993	洛阳钼业	57,800	228,888.00	0.05
71	601800	中国交建	19,900	225,268.00	0.05
72	600011	华能国际	36,100	224,903.00	0.05
73	600089	特变电工	30,600	221,850.00	0.05
74	600271	航天信息	9,500	218,975.00	0.05
75	600196	复星医药	8,600	217,580.00	0.05
76	600115	东方航空	34,100	213,807.00	0.05
77	600383	金地集团	17,700	211,161.00	0.04
78	601985	中国核电	37,800	210,168.00	0.04
79	601099	太平洋	59,000	210,040.00	0.04
80	601555	东吴证券	20,300	208,075.00	0.04
81	600606	绿地控股	30,400	207,632.00	0.04
82	601600	中国铝业	51,600	202,272.00	0.04
83	600705	中航资本	36,500	197,830.00	0.04
84	600438	通威股份	14,000	196,840.00	0.04
85	600332	白云山	4,800	196,656.00	0.04
86	603589	口子窖	3,000	193,260.00	0.04
87	600522	中天科技	20,800	190,736.00	0.04
88	601788	光大证券	16,600	189,572.00	0.04
89	600867	通化东宝	12,200	187,880.00	0.04
90	600637	东方明珠	17,700	186,558.00	0.04
91	601618	中国中冶	60,000	182,400.00	0.04
92	600516	方大炭素	14,602	179,458.58	0.04
93	600018	上港集团	26,100	178,002.00	0.04
94	600111	北方稀土	13,700	175,908.00	0.04

95	600176	中国巨石	18,300	174,399.00	0.04
96	601919	中远海控	34,500	173,190.00	0.04
97	601607	上海医药	9,300	168,795.00	0.04
98	603019	中科曙光	4,800	168,480.00	0.04
99	601727	上海电气	30,500	164,090.00	0.03
100	601877	正泰电器	7,100	163,939.00	0.03
101	600893	航发动力	7,100	161,241.00	0.03
102	601998	中信银行	25,500	152,235.00	0.03
103	600066	宇通客车	11,000	143,220.00	0.03
104	600023	浙能电力	32,200	142,324.00	0.03
105	600068	葛洲坝	22,800	142,044.00	0.03
106	601198	东兴证券	11,800	140,184.00	0.03
107	600004	白云机场	7,700	140,140.00	0.03
108	600809	山西汾酒	2,000	138,100.00	0.03
109	601881	中国银河	11,100	135,975.00	0.03
110	600926	杭州银行	16,300	135,779.00	0.03
111	600600	青岛啤酒	2,700	134,811.00	0.03
112	600489	中金黄金	13,100	134,537.00	0.03
113	601997	贵阳银行	15,400	133,210.00	0.03
114	600362	江西铜业	8,400	132,216.00	0.03
115	600535	天士力	7,800	129,090.00	0.03
116	601233	桐昆股份	8,300	128,733.00	0.03
117	600398	海澜之家	14,100	127,887.00	0.03
118	600482	中国动力	5,400	127,548.00	0.03
119	600153	建发股份	14,100	125,208.00	0.03
120	600085	同仁堂	4,300	124,700.00	0.03
121	601138	工业富联	10,200	122,910.00	0.03
122	600699	均胜电子	5,400	115,344.00	0.02
123	600208	新湖中宝	36,300	113,982.00	0.02
124	600298	安琪酵母	3,600	113,868.00	0.02
125	603799	华友钴业	5,330	113,582.30	0.02
126	603160	汇顶科技	800	111,040.00	0.02
127	603858	步长制药	4,200	108,234.00	0.02
128	601878	浙商证券	11,500	106,950.00	0.02
129	600977	中国电影	6,800	106,488.00	0.02
130	600528	中铁工业	9,100	105,287.00	0.02
131	600497	驰宏锌锗	20,700	105,156.00	0.02
132	601992	金隅集团	27,000	101,520.00	0.02
133	600118	中国卫星	4,400	99,220.00	0.02
134	600760	中航沈飞	3,300	95,799.00	0.02
135	600038	中直股份	2,300	94,346.00	0.02
136	601238	广汽集团	8,300	90,719.00	0.02

137	600297	广汇汽车	20,100	89,646.00	0.02
138	601117	中国化学	14,700	88,494.00	0.02
139	600079	人福医药	8,300	87,150.00	0.02
140	600549	厦门钨业	5,900	84,429.00	0.02
141	600688	上海石化	16,100	83,076.00	0.02
142	600466	蓝光发展	13,100	81,482.00	0.02
143	600643	爱建集团	8,500	81,430.00	0.02
144	601633	长城汽车	9,700	80,219.00	0.02
145	601699	潞安环能	10,000	79,400.00	0.02
146	603259	药明康德	900	78,012.00	0.02
147	600737	中粮糖业	8,700	75,516.00	0.02
148	600266	北京城建	9,360	75,441.60	0.02
149	600008	首创股份	20,700	72,864.00	0.02
150	601360	三六零	3,200	68,416.00	0.01
151	601066	中信建投	3,200	67,456.00	0.01
152	601228	广州港	15,500	64,790.00	0.01
153	600435	北方导航	7,000	62,930.00	0.01
154	600025	华能水电	15,300	62,271.00	0.01
155	600060	海信电器	6,900	59,478.00	0.01
156	600598	北大荒	5,100	54,723.00	0.01
157	600158	中体产业	5,200	53,196.00	0.01
158	600373	中文传媒	4,200	52,752.00	0.01
159	600884	杉杉股份	4,800	51,120.00	0.01
160	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
161	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
162	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
163	601108	财通证券	3,000	32,940.00	0.01
164	601828	美凯龙	2,500	30,375.00	0.01
165	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
166	601838	成都银行	3,000	26,490.00	0.01
167	603156	养元饮品	700	25,956.00	0.01
168	603260	合盛硅业	500	23,530.00	0.00
169	603659	璞泰来	500	23,510.00	0.00
170	601990	南京证券	2,200	21,802.00	0.00
171	603486	科沃斯	420	12,705.00	0.00

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末基金资产净值 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	601318	中国平安	7,107,156.00	1.77
2	600519	贵州茅台	3,677,971.00	0.92

3	600036	招商银行	2,706,189.00	0.67
4	601166	兴业银行	1,942,825.00	0.48
5	600030	中信证券	1,463,217.00	0.36
6	600887	伊利股份	1,433,090.00	0.36
7	600276	恒瑞医药	1,336,634.00	0.33
8	601328	交通银行	1,334,199.00	0.33
9	600016	民生银行	1,232,850.00	0.31
10	601288	农业银行	1,104,561.00	0.28
11	600000	浦发银行	1,071,531.00	0.27
12	601668	中国建筑	1,019,233.00	0.25
13	601601	中国太保	875,958.00	0.22
14	600837	海通证券	856,800.00	0.21
15	600900	长江电力	842,617.00	0.21
16	600048	保利地产	759,535.00	0.19
17	600104	上汽集团	756,887.00	0.19
18	601169	北京银行	732,615.00	0.18
19	601211	国泰君安	686,185.00	0.17
20	601766	中国中车	670,478.00	0.17

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	603915	国茂股份	58,482.35	0.01
2	603217	元利科技	47,298.16	0.01

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	62,539,426.72
卖出股票收入(成交)总额	105,780.51

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

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:无。

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

在开放式基金投资方面,考虑到基金费率优惠等因素,本基金将主要投资于本基金管理人旗下的基金,同时基于南方基金评价系统对基金管理公司及其管理的基金的评级,将投资于管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的基金,以分享资本市场的成长。

在股票型基金选择上,对于主动管理的股票型基金,使用动量策略,重点参考基金规模、历史年化收益率、是否开放申购赎回等因素,选择优胜者进行投资。对于指数基金,由于具有高透明度、风格明确、费用低等多项优势,通过优选指数基金,可配合市场、行业板块轮动等,在不同指数基金间调换,同时可运用事件套利、配对交易等组合策略套利等,增强基金投资收益。被动管理的指数基金,使用跟踪误差、累计偏离、基金规模、是否是市场基准指数、是否开放申购赎回等因素,选择优胜者进行投资。

在混合型基金选择上,考虑到混合型基金投资仓位的变化、基金投资风格、投资标的等因素,将重点选择业绩优异、风格鲜明、风险控制较好的基金进行投资。

对于主动管理的债券基金、货币市场基金,采用长期投资业绩领先、基金规模较大、流动性较好、持有债券的平均久期适当、可以准确识别信用风险并且投资操作风格与当前市场环境相匹配的基金管理人,重点参考基金规模、历史年化收益率、波动率、夏普比例、是否开放申购赎回等因素。

大宗商品基金选择上,重点选择具备有效抵御通胀,与其他资产的相关度低的基金。

在上市的 ETF、LOF 的套利投资方面,通过量化套利策略以及先进的交易手段,及时捕捉市场的折溢价机会。

报告期内,本基金主要投资于开放式基金,总体风险中等,符合基金合同约定的投资政策、

投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	001580	南方利安灵活配置混合 C	契约型开放式	45,770,812.17	50,393,664.20	10.68	是
2	202103	南方多利增强债券 A	契约型开放式	24,702,478.36	27,316,000.57	5.79	是
3	519069	汇添富价值精选混合 A	契约型开放式	8,515,625.84	20,880,314.56	4.42	否
4	000147	易方达高等级信用债券 A	契约型开放式	17,553,389.61	20,730,553.13	4.39	否
5	000148	易方达高等级信用债券 C	契约型开放式	17,571,812.58	20,682,023.41	4.38	否
6	511810	南方理财金交易货币 H	契约型开放式 (ETF)	200,396.00	20,038,798.42	4.25	是
7	160916	大成优选混合 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	6,887,726.88	19,664,460.24	4.17	否

8	166005	中欧价值发现混合 A	契约型开放式	12,704,050.08	19,559,155.50	4.14	否
9	002624	广发优企精选灵活配置混合	契约型开放式	11,750,568.61	16,768,061.41	3.55	否
10	485111	工银瑞信双利债券 A	契约型开放式	10,798,596.11	16,467,859.07	3.49	否
11	159949	华安创业板 50ETF	契约型开放式 (ETF)	29,600,900.00	15,658,876.10	3.32	否
12	000563	南方通利债券 A	契约型开放式	13,588,425.38	15,219,036.43	3.22	是
13	002803	东方红沪港深灵活配置混合	契约型开放式	9,029,272.65	15,087,914.60	3.20	否
14	002701	东方红汇阳债券 A	契约型开放式	13,211,131.09	14,373,710.63	3.05	否
15	202110	南方润元纯债债券 C	契约型开放式	9,852,216.74	12,492,610.83	2.65	是
16	000527	南方新优享灵活配置混合 A	契约型开放式	4,595,814.52	11,241,362.32	2.38	是
17	001938	中欧时代先锋股票 A	契约型开放式	8,128,200.54	10,660,135.01	2.26	否
18	110008	易方达稳健收	契约型开	7,858,377.86	10,343,982.78	2.19	否

		益债券 B	放式				
19	270029	广发聚 财信用 债券 A	契约 型开 放式	8,840,848.81	10,246,543.77	2.17	否
20	004585	鹏扬汇 利债券 A	契约 型开 放式	9,296,206.77	10,010,155.45	2.12	否
21	510300	华泰柏 瑞沪深 300ETF	契约 型开 放式 (ETF)	2,441,327.00	9,421,080.89	2.00	否
22	159915	易方达 创业板 ETF	契约 型开 放式 (ETF)	5,500,548.00	8,014,298.44	1.70	否
23	002015	南方荣 光灵活 配置混 合 A	契约 型开 放式	6,786,823.38	7,838,781.00	1.66	是
24	002650	东方红 稳添利 纯债债 券	契约 型开 放式	6,681,530.46	7,238,770.10	1.53	否
25	510500	南方中 证 500ETF	契约 型开 放式 (ETF)	860,780.00	4,589,678.96	0.97	是
26	512100	南方中 证 1000ETF	契约 型开 放式 (ETF)	2,288,200.00	1,473,600.80	0.31	是
27	202304	南方理 财 14 天 债券 B	契约 型开 放式	149,593.83	149,593.83	0.03	是
28	003474	南方天	契约	8,984.24	8,984.24	0.00	是

		天利货 币 B	型开 放式				
29	002325	南方日 添益货 币 E	契约 型开 放式	2,138.41	2,138.41	0.00	是

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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收到公开谴责、处罚的情形

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。

7.13.2 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

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。

7.13.3 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	52,163.51
2	应收证券清算款	1,179.87
3	应收股利	86.01
4	应收利息	1,832.91
5	应收申购款	493,375.50
6	其他应收款	12,333.54
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	560,971.34

7.13.4 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债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末投资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 (%)
南方养老目 标日期 2035 (FOF) A	64,323	6,113.68	85,471,237.09	21.73%	307,778,843.34	78.27%
南方养老目 标日期 2035 (FOF) C	14,517	3,981.32	7,021,583.32	12.15%	50,775,167.07	87.85%
合计	78,840	5,721.04	92,492,820.41	20.51%	358,554,010.41	79.49%

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),
 $\text{户均持有的基金份额的合计数} = \text{期末基金份额总额} / \text{期末持有人户数合计}$ 。

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	南方养老目标日期 2035 (FOF) A	1,905,922.43	0.4847
	南方养老目标日期 2035 (FOF) C	354,002.00	0.6125
	合计	2,259,924.43	0.5010

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	南方养老目标日期 2035 (FOF) A	0~10
	南方养老目标日期 2035 (FOF) C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	南方养老目标日期 2035 (FOF) A	-
	南方养老目标日期 2035 (FOF) C	-
	合计	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方养老目标日期 2035 (FOF) A	南方养老目标日期 2035 (FOF) C
基金合同生效日 (2018 年 11 月 6 日) 基金 份额总额	329,777,936.20	50,581,081.47
本报告期期初基金份额总 额	346,538,394.69	52,493,445.69
本报告期基金总申购份额	46,711,685.74	5,303,304.70
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	393,250,080.43	57,796,750.39

§ 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

本报告期内，基金管理人、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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，南方养老 2035FOF 所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

10.6 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。

10.7 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、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
海通证券	1	62,323,901.47	100.00%	50,546.37	105.54%	
华泰证券	1	-	-	-2,653.31	-5.54%	
国信证券	1	-	-	-	-	

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。

10.8.2 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
国信证券	-	-	-	-	-	-	54,477,672.22	23.84%
海通证券	-	-	4,045,200,000.00	100.00%	-	-	174,065,849.72	76.16%
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 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广发银行为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报	2019-01-24
2	南方基金关于旗下部分基金增加日照银行、恒泰证券、大通证券为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报	2019-01-30
3	南方基金关于旗下部分基金增加中信银行为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报	2019-02-15
4	南方基金关于旗下部分基金增加浦发银行为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报	2019-03-06
5	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证券时报	2019-04-01
6	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	证券时报	2019-04-02
7	南方基金关于调整旗下部分基金2019年五一劳动节期间非港股通交易日申购赎回安排的提示性公告	证券时报	2019-04-27
8	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	证券时报	2019-06-25

9	关于公司旗下基金调整停牌股票和债券估值方法的提示性公告	证券时报	2019-06-26
---	-----------------------------	------	------------

§ 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

注: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养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 的文;
- 2、《南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》;
- 3、《南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 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、《南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 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>