

南华丰淳混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 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:2020 年 08 月 28 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年8月27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2020年1月1日起至6月30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 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48

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	48
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 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	5,337,121.83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	2,391,711.14份	2,945,410.69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	路秀妍	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3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	张金良

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.nanhuafunds.com
基金中期报告备置地点	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
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(2020年01月01日-2020年06月30日)	
	南华丰淳混合A	南华丰淳混合C
本期已实现收益	239,287.71	282,933.64
本期利润	593,474.75	702,815.73
加权平均基金份额本期利润	0.2561	0.2487
本期加权平均净值利润率	23.08%	23.01%
本期基金份额净值增长率	26.96%	26.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)	
	南华丰淳混合A	南华丰淳混合C
期末可供分配利润	-193,298.11	-328,948.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0808	-0.1117
期末基金资产净值	3,177,081.78	3,795,024.12
期末基金份额净值	1.3284	1.2885
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)	
	南华丰淳混合A	南华丰淳混合C
基金份额累计净值增长率	32.84%	28.85%

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	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	17.86%	1.38%	5.48%	0.67%	12.38%	0.71%
过去三个月	33.60%	1.66%	9.34%	0.67%	24.26%	0.99%
过去六个月	26.96%	2.18%	1.71%	1.13%	25.25%	1.05%
过去一年	45.69%	1.74%	7.45%	0.91%	38.24%	0.83%
自基金合同生效起至今	32.84%	1.59%	5.13%	1.00%	27.71%	0.59%

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
过去一个月	17.82%	1.38%	5.48%	0.67%	12.34%	0.71%
过去三个月	33.48%	1.65%	9.34%	0.67%	24.14%	0.98%
过去六个月	26.71%	2.18%	1.71%	1.13%	25.00%	1.05%
过去一年	44.58%	1.74%	7.45%	0.91%	37.13%	0.83%
自基金合同生效起至今	28.85%	1.59%	5.13%	1.00%	23.72%	0.59%

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

南华丰淳混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年12月26日-2020年06月30日)



南华丰淳混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年12月26日-2020年06月30日)



§ 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。

截止报告期末，南华基金管理有限公司旗下共管理10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、南华瑞扬纯债债券型证券投资基金、南华瑞恒中短债债券型证券投资基金、南华瑞元定期开放债券型发起式证券投资基金、南华价值启航纯债债券型证券投资基金、南华瑞泽债券型证券投资基金及南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金，资产管理规模约34.62亿元。

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	-	12	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)、南华丰淳混合型证券投资基金基金经理(2017年12月16日起任职)及南华瑞扬纯债债券型证券投资基金基金经理(2020年5月27日起任职)。
曹进前	本基金基金经理	2017-12-26	2020-01-17	10	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，现任南华瑞恒中短债债券型证券投资基金基金经理(2019年1月29日起任职)、南华瑞元定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2019年4月11日起任职)、南华价值启航纯债债券型证券投资基金基金经理(2019年11月22日起任职)及南华瑞泽债券型证券投资基金基金经理(2020年1月19日起任职)；曾任南华丰淳混合

					型证券投资基金基金经理（2017年12月26日起至2020年1月16日止）、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日起至2020年1月16日止）、南华瑞扬纯债债券型证券投资基金基金经理（2019年1月17日起至2020年1月16日止）。
徐超	本基金基金经理	2020-01-17	-	8	2006年7月至2008年11月任中美大都会人寿保险股份有限公司顾问行销市场部高级助理；2008年11月至2012年8月任中诚信国际评级有限责任公司金融机构评级部总经理助理/高级分析师；2012年9月至2015年6月任泰达宏利基金管理有限公司固定收益部高级研究员；2015年6月至2019年4月任于方正富邦基金管理有限公司基金投资部任职，期间曾任基金经理。现任南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金经理（2019年9月10日起任职）、南华丰淳混合型证券投资基金基金经理（2020年1月17日起任职）。

注：

（1）基金经理刘斐的任职日期是指本基金基金合同生效之日；基金经理徐超的任职日期是指公司做出决定后公告之日；

（2）基金经理曹进前的任职日期是指本基金基金合同生效之日，离任日期是公司作出

决定后公告之日；

(3) 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) 本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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。

本报告期内，公司对不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合向交易的差价进行分析，未发现违反公平交易原则的异常情形。

4.3.2 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

2020年上半年经济运行稳步回升，疫情情况、经济复工复产进度、流动性以及政策调节力度加之中美关系是影响市场指数波动的主要因素。受疫情影响，1季度GDP下降6.8%，中国从3月开始已经率先取得抗疫成效，2季度GDP增速恢复至正增长3.2%，上半年宏观经济运行平稳，为证券市场营造了比较宽松的环境。国内经济运行转好的同时，外部中美贸易摩擦反复给加剧了股市的不确定性。资金层面，虽然短期央行表态偏中性，但预计全年市场流动性仍将维持宽松。

报告期内股市结构性机会突出，本基金主要布局在医药和TMT等行业，通过提高个股集中度，重仓持有优质上市公司的方法获取了较好回报。随着市场波动加剧，本基金仍将坚持价值投资理念，自下而上精选优质上市公司中长期持有，密切关注系统性风险，为投资人获得长期稳健回报。

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1.3284元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为26.96%，同期业绩比较基准收益率为1.71%；截至报告期末南华丰淳混合C基金份额净值为1.2885元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为26.71%，同期业绩比较基准收益率为1.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济运行稳步回升，2季度经济增长实现由负转正。上半年国内疫情防控形势不断向好，复工复产、复商复市有序推进，宏观政策效应持续显现，经济增长实现了由负转正，整体经济稳步复苏态势明显。二季度，我国GDP为250110亿元，按不变价格计算，比上年同期增长3.2%，一季度为下降6.8%，经济增速实现由负转正，经济整体呈现快速回升态势。上半年，我国GDP为456614亿元，按不变价格计算，比上年同期下降1.6%。整体上，全国经济复工复产趋势良好，且银保监会及央行对金融进一步支持实体经济相继表态，预计下半年国内经济仍将持续回升。

随着中国资本市场市场化改革的持续稳步推进，证券市场有望进一步吸引中长期投资者入市。同时再融资的放松、货币环境的宽松、资管新规的全面落实和保本保收益理财的逐步减少，居民有望将更多长期资金配置于优质稳健的权益类资产。随着外资在我国股市参与度的提升，一方面我国股市与境外市场的关联度会提升，另一方面我国股市有望慢慢从高波动、高换手的新兴市场风格向成熟稳健、资源优化配置的国际成熟市场靠拢。长期来看，随着我国经济结构转型的稳步推进，慢牛更可期待。真正盈利能力强、符合未来经济结构转型发展的优质公司在未来有望进一步享受国际化红利。未来影响A股市场的黑天鹅可能主要来自海外层面的变化。

此外，资本市场的改革仍在持续进行，外资金金融机构准入进一步放宽，创业板注册制、新三板精选层已经陆续实施，证监会对上市公司信批违规及处罚措施进一步从严，

都有助于资本市场的更加开放和规范，推动市场环境的持续改善。综合内外部的变化，在流动性宽松的基础上，消费、医药和科技行业结构性机会突出，行业龙头公司优势愈加凸显；券商行业受益于资本市场改革和成交量的放大，短期低估值的金融、地产、周期仍有补涨的机会；外需行业有望出现拐点，部分行业出现延期订单，重点关注受益于欧美经济刺激政策的子行业。

4.6 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。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 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。

4.8 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

本基金报告期存在连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万的情形，时间段为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会提交解决方案。

§ 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”）在南华丰淳混合型证券投资基金（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 托管人对本中期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 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 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：2020年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	996,514.30	478,706.40
结算备付金		24,601.29	3,131.87
存出保证金		9,570.21	22,506.50
交易性金融资产	6.4.7.2	6,131,444.78	5,370,909.78
其中：股票投资		6,131,444.78	5,370,909.78
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		—	—
买入返售金融资产		—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.3	136.59	95.24
应收股利		—	—

应收申购款		274,532.84	2,161.94
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		7,436,800.01	5,877,511.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		145,476.92	100.00
应付赎回款		229,584.46	40,253.73
应付管理人报酬		6,016.40	5,948.83
应付托管费		1,002.75	991.47
应付销售服务费		1,074.82	982.83
应付交易费用	6.4.7.4	6,675.36	3,790.43
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	74,863.40	50,026.27
负债合计		464,694.11	102,093.56
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.6	5,337,121.83	5,599,021.05
未分配利润	6.4.7.7	1,634,984.07	176,397.12
所有者权益合计		6,972,105.90	5,775,418.17
负债和所有者权益总计		7,436,800.01	5,877,511.73

注:

报告截止日2020年6月30日, 基金份额总额5,337,121.83份。其中南华丰淳混合A类基金

份额净值1.3284元，基金份额总额2,391,711.14份；南华丰淳混合C类基金份额净值1.2885元，基金份额总额2,945,410.69份。

6.2 利润表

会计主体：南华丰淳混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年06月30日
一、收入		1,403,734.87	1,384,010.44
1. 利息收入		2,424.30	9,461.14
其中：存款利息收入	6.4.7.8	2,424.30	9,461.14
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		620,490.64	4,220.26
其中：股票投资收益	6.4.7.9	603,501.71	-200,088.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.10	16,988.93	204,308.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	774,069.13	1,271,892.67
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. 12	6, 750. 80	98, 436. 37
减: 二、费用		107, 444. 39	280, 682. 59
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	33, 547. 31	99, 945. 53
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	5, 591. 28	16, 657. 53
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	6, 051. 70	19, 369. 74
4. 交易费用	6. 4. 7. 13	37, 391. 08	114, 957. 01
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6. 4. 7. 14	24, 863. 02	29, 752. 78
三、利润总额 (亏损总额以 “-” 号填列)		1, 296, 290. 48	1, 103, 327. 85
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以 “-” 号填列)		1, 296, 290. 48	1, 103, 327. 85

6.3 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: 2020年01月01日至2020年06月30日

单位: 人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年06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)	5, 599, 021. 05	176, 397. 12	5, 775, 418. 17
二、本期经营活动产	-	1, 296, 290. 48	1, 296, 290. 48

生的基金净值变动数(本期利润)			
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)	-261,899.22	162,296.47	-99,602.75
其中: 1. 基金申购款	4,839,665.12	775,941.46	5,615,606.58
2. 基金赎回款	-5,101,564.34	-613,644.99	-5,715,209.33
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)	5,337,121.83	1,634,984.07	6,972,105.90
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06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)	8,027,830.31	-2,342,467.80	5,685,362.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,103,327.85	1,103,327.85
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)	15,514,356.88	-1,129,347.19	14,385,009.69
其中: 1. 基金申购款	49,352,626.84	-5,361,813.88	43,990,812.96
2. 基金赎回款	-33,838,269.96	4,232,466.69	-29,605,803.27
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)	23,542,187.19	-2,368,487.14	21,173,700.05

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：

朱坚

连省

母学贤

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、政府支持债券、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(但须符合中国证监会相关规定)。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 X 75% + 中债综合全价(总值)指数收益率 X 25%。

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<年度报告和中期报告>》、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2020年6月30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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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[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，包括买卖债券的差价收入，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。

(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 2020年06月30日
活期存款	996,514.30
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	996,514.30

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2020年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,579,562.27	6,131,444.78	1,551,882.51
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		4,579,562.27	6,131,444.78	1,551,882.51

6.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
----	--------------------

应收活期存款利息	121.19
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	11.10
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	4.30
合计	136.59

6.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	6,675.36
银行间市场应付交易费用	—
合计	6,675.36

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	0.38
预提费用	74,863.02
合计	74,863.40

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 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2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,783,304.55	2,783,304.55
本期申购	1,861,201.05	1,861,201.05
本期赎回（以“-”号填列）	-2,252,794.46	-2,252,794.46
本期末	2,391,711.14	2,391,711.14

6.4.7.6.2 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2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,815,716.50	2,815,716.50
本期申购	2,978,464.07	2,978,464.07
本期赎回（以“-”号填列）	-2,848,769.88	-2,848,769.88
本期末	2,945,410.69	2,945,410.69

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 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	-529,434.28	658,196.54	128,762.26
本期利润	239,287.71	354,187.04	593,474.75
本期基金份额交易产生的变动数	96,848.46	-33,714.83	63,133.63
其中：基金申购款	-153,446.40	502,047.04	348,600.64
基金赎回款	250,294.86	-535,761.87	-285,467.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-193,298.11	978,668.75	785,370.64

6.4.7.7.2 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	-607,432.27	655,067.13	47,634.86
本期利润	282,933.64	419,882.09	702,815.73
本期基金份额交易产生的变动数	-4,449.37	103,612.21	99,162.84
其中：基金申购款	-388,623.23	815,964.05	427,340.82
基金赎回款	384,173.86	-712,351.84	-328,177.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-328,948.00	1,178,561.43	849,613.43

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	2,175.34
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	182.61
其他	66.35
合计	2,424.30

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	14,354,639.78
减：卖出股票成本总额	13,751,138.07
买卖股票差价收入	603,501.71

6.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	16,988.93
基金投资产生的股利收益	—
合计	16,988.93

6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	774,069.13
——股票投资	774,069.13
——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	774,069.13

6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	6,750.57
转换费收入	0.23
合计	6,750.80

6.4.7.13 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	37,391.08
银行间市场交易费用	—
合计	37,391.08

6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	—
合计	24,863.02

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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发生未变化。

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

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**

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

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 2020年01月01日至202 0年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至201 9年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	33,547.31	99,945.53
其中：支付销售机构的客户维护费	12,686.66	18,411.06

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X1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,591.28	16,657.53

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。

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 2020年01月01日至2020年06月30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
南华期货 公司	0.00	26.89	26.89
南华基金	0.00	7.53	7.53
中国邮政 储蓄银行	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	34.42	34.42
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30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
南华期货 公司	0.00	20.76	20.76
南华基金	0.00	9,770.86	9,770.86
中国邮政 储蓄银行	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	9,791.62	9,791.62

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 $\times$ 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

无。

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

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

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 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30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	996,514.30	2,175.34	1,389,663.59	8,483.61

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2020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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

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。

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2020年6月30日，本基金未持有债券投资(2019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。

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%。

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%。

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。

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。

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、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年06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	996,514.30	-	-	-	996,514.30
结算备付金	24,601.29	-	-	-	24,601.29
存出保证金	9,570.21	-	-	-	9,570.21
交易性金融资产	-	-	-	6,131,444.78	6,131,444.78
应收利息	-	-	-	136.59	136.59
应收申购款	-	-	-	274,532.84	274,532.84
资产总计	1,030,685.80	-	-	6,406,114.21	7,436,800.01
负债					
应付证券清算款	-	-	-	145,476.92	145,476.92
应付赎回款	-	-	-	229,584.46	229,584.46
应付管理人报酬	-	-	-	6,016.40	6,016.40
应付托管费	-	-	-	1,002.75	1,002.75
应付销售服务费	-	-	-	1,074.82	1,074.82
应付交易费用	-	-	-	6,675.36	6,675.36
其他负债	-	-	-	74,863.40	74,863.40
负债总计	-	-	-	464,694.11	464,694.11
利率敏感度缺口	1,030,685.80	-	-	5,941,420.10	6,972,105.90
上年度末2019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	478,706.40	-	-	-	478,706.40

款					
结算备付金	3,131.87	-	-	-	3,131.87
存出保证金	22,506.50	-	-	-	22,506.50
交易性金融资产	-	-	-	5,370,909.78	5,370,909.78
应收利息	-	-	-	95.24	95.24
应收申购款	-	-	-	2,161.94	2,161.94
资产总计	504,344.77	-	-	5,373,166.96	5,877,511.73
负债					
应付证券清算款	-	-	-	100.00	100.00
应付赎回款	-	-	-	40,253.73	40,253.73
应付管理人报酬	-	-	-	5,948.83	5,948.83
应付托管费	-	-	-	991.47	991.47
应付销售服务费	-	-	-	982.83	982.83
应付交易费用	-	-	-	3,790.43	3,790.43
其他负债	-	-	-	50,026.27	50,026.27
负债总计	-	-	-	102,093.56	102,093.56
利率敏感度缺口	504,344.77	-	-	5,271,073.40	5,775,418.17

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2020年6月30日，本基金未持有债券投资(2019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(2019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。

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 2020年06月30日		上年度末 2019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	6,131,444.78	87.94	5,370,909.78	93.00
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资	—	—	—	—

产一债券投资				
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	6,131,444.78	87.94	5,370,909.78	93.00

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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升5%	369,143.63	269,358.81
	业绩比较基准下降5%	-369,143.63	-269,358.81

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	6,131,444.78	82.45
	其中：股票	6,131,444.78	82.45
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	1,021,115.59	13.73
8	其他各项资产	284,239.64	3.82
9	合计	7,436,800.01	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,291,324.60	61.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	364,000.00	5.22
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,082,320.18	15.52
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	393,800.00	5.65
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	6,131,444.78	87.94
--	----	--------------	-------

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	300702	天宇股份	4,100	435,912.00	6.25
2	002410	广联达	6,100	425,170.00	6.10
3	002475	立讯精密	7,800	400,530.00	5.74
4	603882	金域医学	4,400	393,800.00	5.65
5	600276	恒瑞医药	4,080	376,584.00	5.40
6	600570	恒生电子	3,493	376,196.10	5.40
7	002007	华兰生物	7,440	372,818.40	5.35
8	300122	智飞生物	3,700	370,555.00	5.31
9	603939	益丰药房	4,000	364,000.00	5.22
10	300294	博雅生物	9,500	356,155.00	5.11
11	300760	迈瑞医疗	1,146	350,332.20	5.02
12	300326	凯利泰	11,700	340,470.00	4.88
13	300750	宁德时代	1,900	331,284.00	4.75
14	002311	海大集团	5,700	271,263.00	3.89
15	603605	珀莱雅	1,300	234,026.00	3.36
16	603533	掌阅科技	4,000	152,520.00	2.19
17	603658	安图生物	900	146,196.00	2.10
18	300482	万孚生物	1,400	145,600.00	2.09
19	688111	金山办公	376	128,434.08	1.84
20	603707	健友股份	1,500	96,855.00	1.39
21	002030	达安基因	2,300	62,744.00	0.90

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	000063	中兴通讯	647,189.00	11.21
2	002410	广联达	551,465.00	9.55
3	603986	兆易创新	443,746.00	7.68
4	300750	宁德时代	434,394.00	7.52
5	603005	晶方科技	377,182.00	6.53
6	002384	东山精密	359,584.00	6.23
7	600276	恒瑞医药	350,325.00	6.07
8	002714	牧原股份	335,496.00	5.81
9	300661	圣邦股份	332,429.00	5.76
10	300326	凯利泰	309,456.00	5.36
11	603939	益丰药房	308,596.00	5.34
12	300294	博雅生物	302,777.00	5.24
13	300702	天宇股份	302,294.00	5.23
14	300122	智飞生物	298,573.00	5.17
15	300601	康泰生物	295,380.00	5.11
16	603882	金域医学	293,397.00	5.08
17	600438	通威股份	284,878.00	4.93
18	002463	沪电股份	282,160.00	4.89
19	002007	华兰生物	281,147.00	4.87
20	603195	公牛集团	273,265.00	4.73
21	688118	普元信息	270,411.05	4.68
22	300015	爱尔眼科	265,036.00	4.59
23	002460	赣锋锂业	257,250.00	4.45
24	002311	海大集团	257,028.00	4.45
25	002185	华天科技	255,902.96	4.43
26	002129	中环股份	230,575.00	3.99
27	002475	立讯精密	216,084.00	3.74

28	300659	中孚信息	204,884.00	3.55
29	601012	隆基股份	203,278.00	3.52
30	603605	珀莱雅	196,343.00	3.40
31	603160	汇顶科技	195,381.00	3.38
32	300014	亿纬锂能	193,172.00	3.34
33	000725	京东方 A	181,995.00	3.15
34	300379	东方通	168,270.00	2.91
35	600536	中国软件	164,279.00	2.84
36	002273	水晶光电	164,068.00	2.84
37	600031	三一重工	162,698.00	2.82
38	002459	晶澳科技	162,355.00	2.81
39	002916	深南电路	155,339.00	2.69
40	603533	掌阅科技	150,083.00	2.60
41	688037	芯源微	149,060.20	2.58
42	300223	北京君正	147,771.00	2.56
43	603259	药明康德	146,048.00	2.53
44	603658	安图生物	145,464.00	2.52
45	603039	泛微网络	141,151.00	2.44
46	300782	卓胜微	132,997.00	2.30
47	002409	雅克科技	121,709.00	2.11
48	300482	万孚生物	120,564.00	2.09
49	600584	长电科技	120,232.00	2.08
50	603305	旭升股份	115,977.00	2.01
51	600885	宏发股份	115,764.00	2.00

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	000063	中兴通讯	613,793.00	10.63
2	002129	中环股份	539,408.48	9.34

3	603986	兆易创新	448,583.00	7.77
4	601100	恒立液压	425,621.86	7.37
5	603005	晶方科技	415,239.00	7.19
6	600309	万华化学	382,063.52	6.62
7	600031	三一重工	376,618.09	6.52
8	300601	康泰生物	376,400.00	6.52
9	002371	北方华创	350,121.02	6.06
10	300661	圣邦股份	345,501.50	5.98
11	002714	牧原股份	334,582.60	5.79
12	002912	中新赛克	328,313.00	5.68
13	002384	东山精密	313,395.00	5.43
14	300059	东方财富	291,113.76	5.04
15	002410	广联达	291,111.52	5.04
16	603259	药明康德	287,664.00	4.98
17	600048	保利地产	276,576.00	4.79
18	601688	华泰证券	271,244.00	4.70
19	600276	恒瑞医药	270,366.00	4.68
20	603195	公牛集团	263,054.00	4.55
21	002185	华天科技	260,625.00	4.51
22	601012	隆基股份	259,740.00	4.50
23	002463	沪电股份	250,635.60	4.34
24	300015	爱尔眼科	243,952.00	4.22
25	600038	中直股份	243,513.92	4.22
26	300659	中孚信息	222,665.00	3.86
27	600438	通威股份	222,568.00	3.85
28	002353	杰瑞股份	213,584.00	3.70
29	688118	普元信息	207,853.15	3.60
30	300014	亿纬锂能	201,468.00	3.49
31	002916	深南电路	192,907.00	3.34
32	600600	青岛啤酒	191,740.60	3.32
33	603882	金域医学	190,768.00	3.30

34	002460	赣锋锂业	189,974.00	3.29
35	000725	京东方 A	188,214.00	3.26
36	002475	立讯精密	178,979.00	3.10
37	603160	汇顶科技	178,860.00	3.10
38	002624	完美世界	178,414.00	3.09
39	600536	中国软件	175,821.00	3.04
40	600030	中信证券	174,330.00	3.02
41	300782	卓胜微	172,628.00	2.99
42	002273	水晶光电	162,144.00	2.81
43	603039	泛微网络	162,076.80	2.81
44	300379	东方通	157,330.00	2.72
45	300750	宁德时代	156,766.00	2.71
46	600562	国睿科技	151,490.24	2.62
47	300223	北京君正	141,048.00	2.44
48	600760	中航沈飞	139,561.28	2.42
49	002459	晶澳科技	132,661.00	2.30
50	688058	宝兰德	124,656.00	2.16
51	688037	芯源微	122,879.81	2.13
52	600885	宏发股份	122,395.00	2.12

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	13,737,603.94
卖出股票收入（成交）总额	14,354,639.78

7.5 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。

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

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

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

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

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,570.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	136.59
5	应收申购款	274,532.84
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	284,239.64

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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
南华 丰淳 混合A	286	8,362.63	0.00	0.00%	2,391,711.14	100.00 0%
南华 丰淳 混合C	429	6,865.76	0.00	0.00%	2,945,410.69	100.00 0%
合计	715	7,464.51	0.00	0.00%	5,337,121.83	100.00 0%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

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

无。

§ 9 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	2,783,304.55	2,815,716.50
本报告期基金总申购份额	1,861,201.05	2,978,464.07
减：本报告期基金总赎回份额	2,252,794.46	2,848,769.88
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	2,391,711.14	2,945,410.69

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期本基金未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，路秀妍女士于2020年2月12日起担任本基金管理人南华基金管理有限公司督察长，总经理朱坚先生不再代行督察长职责。前述人事变动已按规定进行备案及公告。

本报告期内，本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、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发生变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金基金管理人、基金托管人的托管托管业务部门及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚等情况。

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	
开源证券	2	12,249,462.28	43.60%	8,958.14	43.60%	-
东海证券	2	15,842,781.44	56.40%	11,585.79	56.40%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

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。

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	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增浙江同花顺基金销售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、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-01-10
2	南华基金管理有限公司南华丰淳混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券交易所网站、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-01-17
3	南华基金管理有限公司关于公募基金产品2019年4季度报告的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上海证券交易所网站、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-01-20
4	南华丰淳混合型证券投资基金2019年第4季度报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-01-20
5	南华丰淳混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-01-22
6	南华丰淳混合型证券投资基金招募说明书摘要（更新）	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-01-22
7	南华基金管理有限公司关于400客服热线暂停使用的通知	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、上海证券交易所网站、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-02-08
8	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京蛋卷	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、上海	2020-02-13

	基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券交易所网站、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	
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、上海证券交易所网站、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-02-13
10	南华基金管理有限公司关于400客服热线恢复使用的通知	中国证券报、上海证券交易所网站、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-02-21
11	南华丰淳混合型证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-02-22
12	南华丰淳混合型证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-02-22
13	南华丰淳混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-02-22
14	南华丰淳混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-02-22
15	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修改基金合同、托管协议及招募说明书等法律文件的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-02-22
16	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增大连网金基金销售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、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-03-03
17	南华基金管理有限公司关于旗下基金参加万家财富基金销售（天津）有限公司申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-03-04

18	南华基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-03-20
19	南华基金管理有限公司关于旗下基金参加南华期货股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-03-21
20	南华丰淳混合型证券投资基金2019年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-03-31
21	南华基金管理有限公司公募基金2019年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券交易所网站、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-03-31
22	南华丰淳混合型证券投资基金2020年第1季度报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-04-22
23	南华基金管理有限公司旗下全部基金2020年第一季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、上海证券交易所网站、基金管理人网站	2020-04-22
24	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增中信证券华南股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-04-30
25	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增和耕传承基金销售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、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-05-14
26	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增上海陆享基金销售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、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-06-17

27	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增北京唐鼎耀华基金销售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、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-06-18
28	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增北京植信基金销售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、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-06-23
29	南华基金管理有限公司关于旗下部分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、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2020-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	2020/2/18-2020/2/20	792,079.21	-	-	792,079.21	14.84%
	2	2020/1/1-2020/6/30	1,121,453.40	-	-	1,121,453.40	21.01%
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；							

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。

12.2 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

12.3 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

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
二〇二〇年八月二十八日