

# 南华瑞泰 39 个月定期开放债券型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 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:交通银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 30 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。本中期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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021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2021年3月25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                                | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12 |
| 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             | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14 |
| 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       | 14 |
| §5 托管人报告                                | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14 |
| 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 | 14 |
| 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       | 14 |
| §6 中期财务会计报告(未经审计)                       | 14 |
| 6.1 资产负债表                               | 14 |
| 6.2 利润表                                 | 16 |
| 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                               | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 38 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 38 |
| 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       | 38 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 38 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 39 |
| 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      | 39 |
| 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   | 40 |
| 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   | 40 |
| 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      | 40 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 40 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 40 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 40 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 41 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 41 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 41 |

|                                    |    |
|------------------------------------|----|
| 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   | 42 |
| §9 开放式基金份额变动                       | 42 |
| §10 重大事件揭示                         | 42 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议                   | 42 |
| 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   | 42 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼        | 42 |
| 10.4 基金投资策略的改变                     | 43 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况              | 43 |
| 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      | 43 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况             | 43 |
| 10.8 其他重大事件                        | 44 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息                 | 46 |
| 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 | 46 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息                | 46 |
| §12 备查文件目录                         | 47 |
| 12.1 备查文件目录                        | 47 |
| 12.2 存放地点                          | 47 |
| 12.3 查阅方式                          | 47 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                       |             |
|-----------------|-----------------------|-------------|
| 基金名称            | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金 |             |
| 基金简称            | 南华瑞泰39个月定开            |             |
| 基金主代码           | 010278                |             |
| 基金运作方式          | 契约型、定期开放式             |             |
| 基金合同生效日         | 2021年03月25日           |             |
| 基金管理人           | 南华基金管理有限公司            |             |
| 基金托管人           | 交通银行股份有限公司            |             |
| 报告期末基金份额总额      | 2,500,400,776.22份     |             |
| 基金合同存续期         | 不定期                   |             |
| 下属分级基金的基金简称     | 南华瑞泰39个月定开A           | 南华瑞泰39个月定开C |
| 下属分级基金的交易代码     | 010278                | 010279      |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,500,347,258.81份     | 53,517.41份  |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                               |
|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余存续期（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。                                                                                                                                                                                            |
| 投资策略 | <p>1、封闭期投资策略：</p> <p>本基金以封闭期为周期进行投资运作。为力争基金资产在开放前可完全变现，本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资资产到期日（或回售日）不得晚于封闭期到期日。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额</p> |

|        |                                                                       |
|--------|-----------------------------------------------------------------------|
|        | 的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。 |
| 业绩比较基准 | 在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年定期存款利率（税后）+1.0%                         |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金及混合型基金，高于货币市场基金。                            |

## 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      |      | 南华基金管理有限公司                       | 交通银行股份有限公司             |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 路秀妍                              | 陆志俊                    |
|         | 联系电话 | 400-810-5599                     | 95559                  |
|         | 电子邮箱 | services@nanhuafunds.com         | luzj@bankcomm.com      |
| 客户服务电话  |      | 400-810-5599                     | 95559                  |
| 传真      |      | 010-58965908                     | 021-62701216           |
| 注册地址    |      | 浙江省东阳市横店影视产业实验区商务楼               | 中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号 |
| 办公地址    |      | 北京市西城区武定侯街2号泰康国际大厦10层1002-1003单元 | 中国（上海）长宁区仙霞路18号        |
| 邮政编码    |      | 100033                           | 200336                 |
| 法定代表人   |      | 朱坚                               | 任德奇                    |

## 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 | 北京市西城区武定侯街2号泰康国 |

|  |  |                   |
|--|--|-------------------|
|  |  | 际大厦10层1002-1003单元 |
|--|--|-------------------|

### § 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<br>(2021年03月25日（基金合同生效日）-2021年06月30日) |             |
|---------------|-------------------------------------------|-------------|
|               | 南华瑞泰39个月定开A                               | 南华瑞泰39个月定开C |
| 本期已实现收益       | 18,146,098.70                             | 352.34      |
| 本期利润          | 18,146,098.70                             | 352.34      |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0073                                    | 0.0066      |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.72%                                     | 0.66%       |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.73%                                     | 0.66%       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末<br>(2021年06月30日)                     |             |
|               | 南华瑞泰39个月定开A                               | 南华瑞泰39个月定开C |
| 期末可供分配利润      | 18,146,098.70                             | 352.34      |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0073                                    | 0.0066      |
| 期末基金资产净值      | 2,518,493,357.51                          | 53,869.75   |
| 期末基金份额净值      | 1.0073                                    | 1.0066      |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末<br>(2021年06月30日)                     |             |
|               | 南华瑞泰39个月定开A                               | 南华瑞泰39个月定开C |
| 基金份额累计净值增长率   | 0.73%                                     | 0.66%       |

注：

(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

(2) 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南华瑞泰39个月定开A

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|-------|
| 过去一个月          | 0.26%        | 0.01%               | 0.31%              | 0.01%                     | -0.05% | 0.00% |
| 过去三个月          | 0.70%        | 0.01%               | 0.94%              | 0.01%                     | -0.24% | 0.00% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 0.73%        | 0.01%               | 1.01%              | 0.01%                     | -0.28% | 0.00% |

南华瑞泰39个月定开C

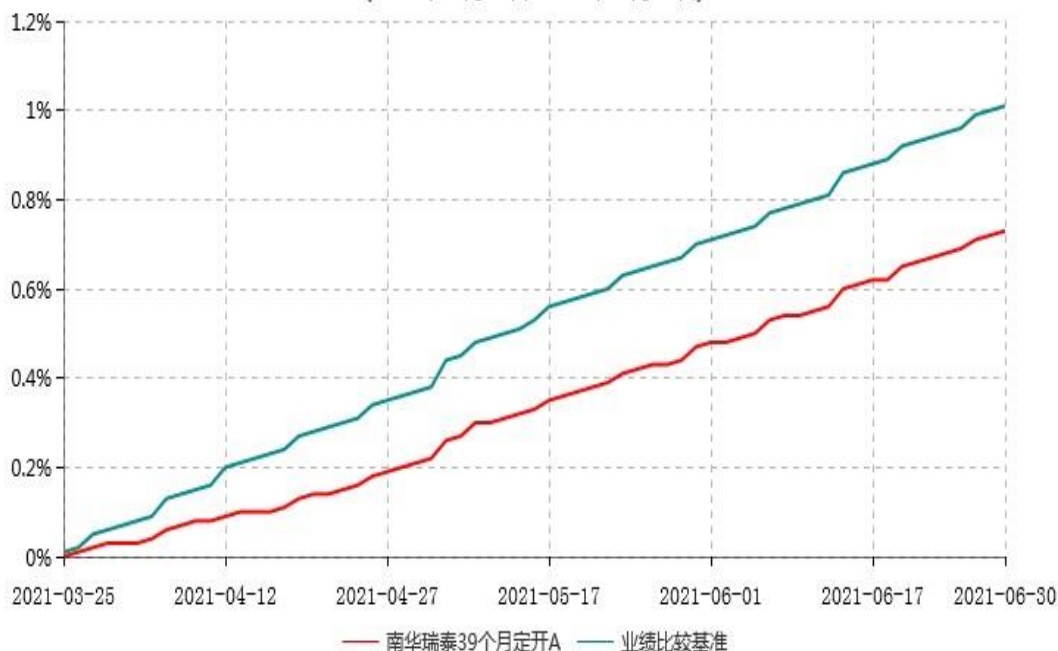
| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|-------|
| 过去一个月          | 0.24%        | 0.01%               | 0.31%              | 0.01%                     | -0.07% | 0.00% |
| 过去三个月          | 0.63%        | 0.01%               | 0.94%              | 0.01%                     | -0.31% | 0.00% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 0.66%        | 0.01%               | 1.01%              | 0.01%                     | -0.35% | 0.00% |

## 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



南华瑞泰39个月定开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

(2021年03月25日-2021年06月30日)



南华瑞泰39个月定开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

(2021年03月25日-2021年06月30日)



注：

(1) 本基金基金合同生效日为 2021 年 3 月 25 日，截至本报告披露时点，本基金基金合同生效不满 1 年；

(2) 本基金的建仓期为 2021 年 3 月 25 日至 2021 年 9 月 24 日，截至本报告期末，本基金仍处于建仓期，建仓期结束时本基金各项资产配置比例应符合基金合同的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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1.8亿元，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12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、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，南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金及南华瑞利纯债债券型证券投资基金。

#### 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       |        |                                                                                                                                                                                                                             |
| 曹进前 | 本基金基金经理 | 2021-03-25      | 2021-05-13 | 11     | 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年任职于泓德基金管理有限公司交易部，担任中央交易员。2017年3月加入南华基金管理有限公司，2021年5月13日离职，曾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日起至2021年5月13日止）、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日起至2021年5月13日止）、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日起至2021年5月13日止）、南华瑞泽债券型证券投资基金基金经理（2020年1月19日起至2021年5月13日止）、南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（2021年3月25日起至2021年5月13日止）、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）。 |
| 孙海龙 | 本基金基金经理 | 2021-04-03 | - | 6 | 硕士研究生，具有基金从业资格。2014年7月至2015年6月在厦门国际银行股份有限公司发展研究部任研究员，2015年8月至2020年5月在天安人寿保险股份有限公司固定收益部任投资经理，2020年5月22日入职南华基金管理有限公司。现任南华瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2020年7月3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（2020年7月3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（2021年4月3日起任职）、南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（2021年4月3日起任职）、南华瑞泽债券型证券投资基金基金经理（2021年4月20日起任职）、南华瑞利纯债债券型证券投资基金基  |

|     |         |            |   |   |                                                                                                                                                                                                                                     |
|-----|---------|------------|---|---|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |         |            |   |   | 金经理（2021年5月20日起任职）。                                                                                                                                                                                                                 |
| 何林泽 | 本基金基金经理 | 2021-04-28 | - | 9 | 硕士研究生，具有基金从业资格。2011年6月28日至2020年11月09日，先后在兴证证券资产管理有限公司固定收益部，担任固定收益研究员、投资主办和副总经理职务。2020年11月10日至2021年4月14日，在建信信托有限责任公司，担任上海证券业务部负责人。2021年4月15日入职南华基金管理有限公司，现任南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（2021年4月28日起任职）、南华瑞泽债券型证券投资基金基金经理（2021年6月3日起任职）。 |

注：

- （1）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，离任日期为公司作出决定后公告之日；基金经理孙海龙、何林泽的任职日期是指公司作出决定后公告之日；
- （2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；
- （3）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《南华瑞泰39个月定期开放债券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。

#### 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

今年上半年经济整体运行平稳，二季度以来，经济基本面已经开始边际转弱。货币政策整体平稳，银行间流动性充裕。上半年采取了进骑乘策略和杠杆策略，拉长了组合久期和提高杠杆比例。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末南华瑞泰39个月定开A基金份额净值为1.0073元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.73%，同期业绩比较基准收益率为1.01%；截至报告期末南华瑞泰39个月定开C基金份额净值为1.0066元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.66%，同期业绩比较基准收益率为1.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年经济增长的压力仍在，预期将会实行积极的财政政策，同时配合宽松的货币政策。PPI将会继续保持高位，但是由于国内消费的疲弱，CPI或许继续保持低位。预期债券市场仍有很好的投资机会，积极看好债券市场。

#### 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

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，托管人在南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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，南华基金管理有限公司在南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

#### 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

本报告期，由南华基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2021年06月30日 |
|-----|-----|--------------------|
|-----|-----|--------------------|

|                 |            |                            |
|-----------------|------------|----------------------------|
| <b>资 产:</b>     |            |                            |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 2,698,688.43               |
| 结算备付金           |            | —                          |
| 存出保证金           |            | —                          |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | —                          |
| 其中: 股票投资        |            | —                          |
| 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          | 6.4.7.3    | —                          |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | —                          |
| 应收证券清算款         |            | —                          |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 25,340,251.84              |
| 应收股利            |            | —                          |
| 应收申购款           |            | —                          |
| 递延所得税资产         |            | —                          |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | 4,222,949,144.44           |
| 资产总计            |            | 4,250,988,084.71           |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021年06月30日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                            |
| 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       |            | 1,731,437,200.84           |
| 应付证券清算款         |            | —                          |
| 应付赎回款           |            | —                          |
| 应付管理人报酬         |            | 310,098.58                 |
| 应付托管费           |            | 103,366.20                 |
| 应付销售服务费         |            | 11.10                      |

|               |          |                  |
|---------------|----------|------------------|
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | 26,725.84        |
| 应交税费          |          | -                |
| 应付利息          |          | 491,226.41       |
| 应付利润          |          | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 72,228.48        |
| 负债合计          |          | 1,732,440,857.45 |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 2,500,400,776.22 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 18,146,451.04    |
| 所有者权益合计       |          | 2,518,547,227.26 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 4,250,988,084.71 |

注：

报告截止日2021年6月30日，基金份额总额2,500,400,776.22份。其中南华瑞泰39个月定开债券A类基金份额净值1.0073元，基金份额总额2,500,347,258.81份；南华瑞泰39个月定开债券C类基金份额净值1.0066元，基金份额总额53,517.41份。

## 6.2 利润表

会计主体：南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021年03月25日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

| 项 目         | 附注号      | 本期<br>2021年03月25日（基金合同<br>生效日）至2021年06月30日 |
|-------------|----------|--------------------------------------------|
| <b>一、收入</b> |          | 22,923,943.80                              |
| 1. 利息收入     |          | 22,923,943.80                              |
| 其中：存款利息收入   | 6.4.7.11 | 1,222,896.45                               |
| 债券利息收入      |          | 19,518,679.22                              |
| 资产支持证券利息收入  |          | -                                          |
| 买入返售金融资产收入  |          | 2,182,368.13                               |
| 其他利息收入      |          | -                                          |



|                            |            |               |
|----------------------------|------------|---------------|
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | -             |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12   | -             |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.13   | -             |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.14   | -             |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.14.5 | -             |
| 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   | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | -             |
| 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   | -             |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 4,777,492.76  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 999,988.09    |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 333,329.36    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 35.89         |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.20   | -             |
| 5. 利息支出                    |            | 3,368,767.71  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 3,368,767.71  |
| 6. 税金及附加                   |            | -             |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.21   | 75,371.71     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 18,146,451.04 |
| <b>减：所得税费用</b>             |            | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 18,146,451.04 |

注：本基金合同生效日为2021年3月25日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021年03月25日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

| 项 目                                    | 本期<br>2021年03月25日（基金合同生效日）至2021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)                        | 2, 500, 400, 776. 22                   | -                | 2, 500, 400, 776. 22 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                      | 18, 146, 451. 04 | 18, 146, 451. 04     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -                                      | -                | -                    |
| 其中：1. 基金申购款                            | -                                      | -                | -                    |
| 2. 基金赎回款                               | -                                      | -                | -                    |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                                      | -                | -                    |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 2, 500, 400, 776. 22                   | 18, 146, 451. 04 | 2, 518, 547, 227. 26 |

注：本基金合同生效日为2021年3月25日，无上年度可比期间数据。

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

南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金(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[2020]1726号《关于准予南华瑞泰39个月定期开放债券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《南华瑞泰39个月定期开放债券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2,500,288,093.04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(2021)第0336号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2021年3月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,500,400,776.22份基金份额，认购资金利息折合基金份额112,683.18份。本基金的基金管理人为南华基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、政府支持机构债券、证券公司短期公司债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具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）。

根据《南华瑞泰39个月定期开放债券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。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。

本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每个开放期开始前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，本基金投资不受上述比例限制。在开放期内，本基金所持有的现金或者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；在封闭期内，本基金不受上述比例限制。本基金业绩比较基准为：封闭期起始日公布的三年定期存款利率（税后）+1.0%。

#### 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》、

《南华瑞泰39个月定期开放债券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。

### 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 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。本期财务报表的实际编制期间为2021年3月25日（基金合同生效日）至2021年6月30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以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及可供出售金融资产。

本基金采用买入持有至到期投资策略投资的债券投资和资产支持证券投资分类为持有至到期投资。持有至到期投资是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且本基金有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。

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。应收款项、持有至到期投资和其他金融负债，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。

对于应收款项、持有至到期投资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。

本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。相应的资产减值损失在利润表中列示在其他费用科目下。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。但是，该转回后的账面价值不应当超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

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

不适用。

#### 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

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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。

于持有至到期投资处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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和托管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

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

#### 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

持有至到期投资是否减值在很大程度上依赖于基金管理人的判断。本基金的基金管理人定期审阅持有至到期投资以评估其是否出现减值情况，并在出现减值情况时评估减值损失的具体金额。发生减值的客观证据包括评估日该金融工具可观察的市场价值出现严重下跌，发行方发生严重财务困难使该金融资产无法在活跃市场继续交易、无法履行合同条款（例如，无法按期偿付利息或本金）等。在进行判断的过程中，本基金的基金管理人需评估发生减值的客观证据对该项投资预计未来现金流的影响。

### 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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85

号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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) 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<br>2021年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 2,698,688.43       |
| 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           | 2,698,688.43       |



## 6.4.7.2 交易性金融资产

无。

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

## 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

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021年06月30日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,084.26           |
| 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     | 25,339,167.58      |
| 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         | 25,340,251.84      |

## 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

|         | 2021年06月30日      |
|---------|------------------|
| 其他应收款   | —                |
| 待摊费用    | —                |
| 持有至到期投资 | 4,222,949,144.44 |
| 合计      | 4,222,949,144.44 |

注：于本期末，本基金持有至到期投资为债券投资，其中交易所市场债券 1,310,000,000.00 元，银行间市场债券 2,912,949,144.44 元。上述持有至到期投资无需计提减值准备。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | —                  |
| 银行间市场应付交易费用 | 26,725.84          |
| 合计          | 26,725.84          |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                  |
| 应付赎回费       | —                  |
| 预提费用        | 72,228.48          |
| 合计          | 72,228.48          |

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 南华瑞泰39个月定开A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(南华瑞泰39个月定开A) | 本期<br>2021年03月25日（基金合同生效日）至2021年06月30日 |      |
|---------------------|----------------------------------------|------|
|                     | 基金份额（份）                                | 账面金额 |

|               |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日       | 2,500,347,258.81 | 2,500,347,258.81 |
| 本期申购          | -                | -                |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                | -                |
| 本期末           | 2,500,347,258.81 | 2,500,347,258.81 |

## 6.4.7.9.2 南华瑞泰39个月定开C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(南华瑞泰39个月定开C) | 本期<br>2021年03月25日（基金合同生效日）至2021年06月30日 |           |
|---------------------|----------------------------------------|-----------|
|                     | 基金份额（份）                                | 账面金额      |
| 基金合同生效日             | 53,517.41                              | 53,517.41 |
| 本期申购                | -                                      | -         |
| 本期赎回（以“-”号填列）       | -                                      | -         |
| 本期末                 | 53,517.41                              | 53,517.41 |

## 6.4.7.10 未分配利润

## 6.4.7.10.1 南华瑞泰39个月定开A

单位：人民币元

| 项目<br>(南华瑞泰39个月定开A) | 已实现部分         | 未实现部分 | 未分配利润合计       |
|---------------------|---------------|-------|---------------|
| 基金合同生效日             | -             | -     | -             |
| 本期利润                | 18,146,098.70 | -     | 18,146,098.70 |
| 本期基金份额交易产生的变动数      | -             | -     | -             |
| 其中：基金申购款            | -             | -     | -             |
| 基金赎回款               | -             | -     | -             |
| 本期已分配利润             | -             | -     | -             |
| 本期末                 | 18,146,098.70 | -     | 18,146,098.70 |

## 6.4.7.10.2 南华瑞泰39个月定开C

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----|-------|-------|---------|
|----|-------|-------|---------|

|                |        |   |        |
|----------------|--------|---|--------|
| (南华瑞泰39个月定开C)  |        |   |        |
| 基金合同生效日        | -      | - | -      |
| 本期利润           | 352.34 | - | 352.34 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -      | - | -      |
| 其中：基金申购款       | -      | - | -      |
| 基金赎回款          | -      | - | -      |
| 本期已分配利润        | -      | - | -      |
| 本期末            | 352.34 | - | 352.34 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年03月25日（基金合同生效日）至2021年06月30日 |
|-----------|----------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 1,149,534.99                           |
| 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 | 73,361.46                              |
| 其他        | -                                      |
| 合计        | 1,222,896.45                           |

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

## 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.15 贵金属投资收益

无。

## 6.4.7.16 衍生工具收益

## 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.17 股利收益

无。

## 6.4.7.18 公允价值变动收益

无。

## 6.4.7.19 其他收入

无。

## 6.4.7.20 交易费用

无。

## 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|          | 2021年03月25日（基金合同生效日）至2021年06月30日 |
|----------|----------------------------------|
| 审计费用     | 31,276.70                        |
| 信息披露费    | 34,751.78                        |
| 汇划手续费    | 2,743.23                         |
| 银行间账户维护费 | 6,200.00                         |
| 证券开户费    | 400.00                           |
| 合计       | 75,371.71                        |

#### 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者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 |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”）   | 基金托管人               |
| 南华期货股份有限公司（“南华期货公司”） | 基金管理人的股东、基金销售机构     |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

##### 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<br>2021年03月25日（基金合同生效日）至2021年06月30日 |
|-----------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 999,988.09                             |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 42.68                                  |

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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年03月25日（基金合同生效日）至2021年06月30日 |
|----------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 333,329.36                             |

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%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×0.05%/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                               |             |      |
|----------------|----------------------------------|-------------|------|
|                | 2021年03月25日（基金合同生效日）至2021年06月30日 |             |      |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |             |      |
|                | 南华瑞泰39个月定开A                      | 南华瑞泰39个月定开C | 合计   |
| 南华期货公司         | 0.00                             | 0.00        | 0.00 |
| 南华基金           | 0.00                             | 0.00        | 0.00 |
| 交通银行           | 0.00                             | 0.00        | 0.00 |
| 合计             | 0.00                             | 0.00        | 0.00 |

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0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南华基金，再由南华基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日C类基金份额销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.25%/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                               |              |
|--------|----------------------------------|--------------|
|        | 2021年03月25日（基金合同生效日）至2021年06月30日 |              |
|        | 期末余额                             | 当期利息收入       |
| 交通银行股份 | 2,698,688.43                     | 1,149,534.99 |



|      |  |  |
|------|--|--|
| 有限公司 |  |  |
|------|--|--|

#### 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

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021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

截止本报告期末2021年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额831,143,200.84元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称   | 回购到期日      | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|--------|--------|------------|--------|-----------|----------------|
| 210303 | 21进出03 | 2021-07-01 | 100.04 | 1,726,000 | 172,663,408.20 |
| 210303 | 21进出03 | 2021-07-02 | 100.04 | 1,050,000 | 105,038,573.93 |
| 210303 | 21进出03 | 2021-07-05 | 100.04 | 5,935,000 | 593,718,034.55 |
| 合计     |        |            |        | 8,711,000 | 871,420,016.68 |

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末2021年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额900,294,000.00元，于2021年07月06日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。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追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

于2021年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资。

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

于2021年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有1,731,437,200.84元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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》且于基金开放期内按照《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%。

于开放期内，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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021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               | 2,698,688.43     | -                | -    | -             | 2,698,688.43     |
| 交易性金融资产            | -                | 4,222,949,144.44 | -    | -             | 4,222,949,144.44 |
| 应收利息               | -                | -                | -    | 25,340,251.84 | 25,340,251.84    |
| 资产总计               | 2,698,688.43     | 4,222,949,144.44 | -    | 25,340,251.84 | 4,250,988,084.71 |
| 负债                 |                  |                  |      |               |                  |
| 卖出回购金融资产款          | 1,731,437,200.84 | -                | -    | -             | 1,731,437,200.84 |
| 应付管理人报酬            | -                | -                | -    | 310,098.58    | 310,098.58       |

|         |                   |                  |   |               |                  |
|---------|-------------------|------------------|---|---------------|------------------|
| 应付托管费   | -                 | -                | - | 103,366.20    | 103,366.20       |
| 应付销售服务费 | -                 | -                | - | 11.10         | 11.10            |
| 应付交易费用  | -                 | -                | - | 26,725.84     | 26,725.84        |
| 应付利息    | -                 | -                | - | 491,226.41    | 491,226.41       |
| 其他负债    | -                 | -                | - | 72,228.48     | 72,228.48        |
| 负债总计    | 1,731,437,200.84  | -                | - | 1,003,656.61  | 1,732,440,857.45 |
| 利率敏感度缺口 | -1,728,738,512.41 | 4,222,949,144.44 | - | 24,336,595.23 | 2,518,547,227.26 |

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

| 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<br>2021年06月30日          |
|    | 市场利率下降25个基点        | 24,362,164.36               |
|    | 市场利率上升25个基点        | -24,143,188.97              |

#### 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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

#### 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              | —                | —             |
|    | 其中：股票             | —                | —             |
| 2  | 基金投资              | —                | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 4,222,949,144.44 | 99.34         |
|    | 其中：债券             | 4,222,949,144.44 | 99.34         |
|    | 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      | 2,698,688.43     | 0.06          |
| 8  | 其他各项资产            | 25,340,251.84    | 0.60          |
| 9  | 合计                | 4,250,988,084.71 | 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

无。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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

无。

### 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

无。

## 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

无。

## 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 4,222,949,144.44 | 167.67       |
|    | 其中：政策性金融债 | 4,222,949,144.44 | 167.67       |
| 4  | 企业债券      | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | -                | -            |
| 7  | 可转债(可交换债) | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 4,222,949,144.44 | 167.67       |

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称      | 数量（张）      | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-----------|------------|------------------|--------------|
| 1  | 210303    | 21进出03    | 19,200,000 | 1,920,705,351.88 | 76.26        |
| 2  | 108803    | 进出2102    | 13,100,000 | 1,310,000,000.00 | 52.01        |
| 3  | 092103107 | 21进出清发107 | 5,700,000  | 569,773,651.40   | 22.62        |

|   |        |        |           |                |      |
|---|--------|--------|-----------|----------------|------|
| 4 | 210207 | 21国开07 | 2,300,000 | 229,527,991.69 | 9.11 |
| 5 | 210402 | 21农发02 | 1,400,000 | 140,519,657.51 | 5.58 |

### 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

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 本基金为债券型基金，不投资股票、权证、可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券等资产，因此不存在投资超出基金合同规定的备选股票库之外的股票的情形。

### 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   | -             |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 25,340,251.84 |
| 5  | 应收申购款   | -             |



|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 6 | 其他应收款 | —             |
| 7 | 待摊费用  | —             |
| 8 | 其他    | —             |
| 9 | 合计    | 25,340,251.84 |

#### 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  |
| 南华瑞泰39个月定开A | 450      | 5,556,327.24 | 2,500,106,500.00 | 99.99% | 240,758.81 | 0.01%   |
| 南华瑞泰39个月定开C | 15       | 3,567.83     | 0.00             | 0.00%  | 53,517.41  | 100.00% |
| 合计          | 465      | 5,377,205.97 | 2,500,106,500.00 | 99.99% | 294,276.22 | 0.01%   |

#### 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 | 南华瑞泰39个月定开A | 2,020.14  | 0.0001%  |
|                  | 南华瑞泰39个月定开C | 20.03     | 0.0374%  |
|                  | 合计          | 2,040.17  | 0.0001%  |

**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 | 南华瑞泰39个月定开A | 0~10              |
|                                | 南华瑞泰39个月定开C | -                 |
|                                | 合计          | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 南华瑞泰39个月定开A | -                 |
|                                | 南华瑞泰39个月定开C | -                 |
|                                | 合计          | -                 |

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

|                            | 南华瑞泰39个月定开A      | 南华瑞泰39个月定开C |
|----------------------------|------------------|-------------|
| 基金合同生效日(2021年03月25日)基金份额总额 | 2,500,347,258.81 | 53,517.41   |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额      | -                | -           |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额    | -                | -           |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额     | -                | -           |
| 本报告期期末基金份额总额               | 2,500,347,258.81 | 53,517.41   |

**§ 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，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，本基金基金管理人无重大人事变动，基金托管人交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

**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，未发生涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金根据基金合同要求开展投资，投资策略没有发生显著改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

#### 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，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

#### 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 |    |
| 申万宏源 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 平安证券 | 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，资质雄厚，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。

##### 10.7.2 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<br>金额 | 占当期<br>债券成<br>交总额<br>的比例 | 成交金额              | 占当期债券<br>回购成交总<br>额的比例 | 成交<br>金额 | 占当期权<br>证成交总<br>额的比例 | 成交<br>金额 | 占当期<br>基金成<br>交总额<br>的比例 |
|------|----------|--------------------------|-------------------|------------------------|----------|----------------------|----------|--------------------------|
| 申万宏源 | -        | -                        | -                 | -                      | -        | -                    | -        | -                        |
| 平安证券 | -        | -                        | 15,463,509,000.00 | 100.00%                | -        | -                    | -        | -                        |

## 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  | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金合同                               | 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 | 2021-01-30 |
| 2  | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金托管协议                               | 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 | 2021-01-30 |
| 3  | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书                              | 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 | 2021-01-30 |
| 4  | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金份额发售公告                           | 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 | 2021-01-30 |
| 5  | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要                     | 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 | 2021-01-30 |
| 6  | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要                     | 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 | 2021-01-30 |
| 7  | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金 基金合同及招募说明书提示性公告                   | 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 | 2021-01-30 |
| 8  | 南华基金管理有限公司关于南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金参与部分代销机构开展的认购费率优惠活动的公告 | 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 | 2021-02-01 |

|    |                                            |                                             |            |
|----|--------------------------------------------|---------------------------------------------|------------|
| 9  | 南华基金管理有限公司关于南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金提前结束募集的公告 | 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                 | 2021-03-24 |
| 10 | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告              | 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                 | 2021-03-26 |
| 11 | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告              | 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                 | 2021-04-03 |
| 12 | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）-2021年第1号    | 中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站                       | 2021-04-07 |
| 13 | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新A类份额        | 中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站                       | 2021-04-07 |
| 14 | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新C类份额        | 中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站                       | 2021-04-07 |
| 15 | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告              | 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 | 2021-04-28 |
| 16 | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）-2021年第2号    | 中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站                       | 2021-04-30 |
| 17 | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新A类份额        | 中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站                       | 2021-04-30 |
| 18 | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新C类份额        | 中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站                       | 2021-04-30 |
| 19 | 南华瑞泰39个月定期开放债                              | 中国证券报、上海证券报、                                | 2021-05-13 |

|    |                                           |                                             |            |
|----|-------------------------------------------|---------------------------------------------|------------|
|    | 券型证券投资基金基金经理变更公告                          | 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             |            |
| 20 | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书更新-2021年第3号     | 中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站                       | 2021-05-15 |
| 21 | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新A类份额       | 中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站                       | 2021-05-15 |
| 22 | 南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新C类份额       | 中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站                       | 2021-05-15 |
| 23 | 南华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海基煜基金销售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 | 2021-06-25 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |                |      |      | 报告期末持有基金情况     |        |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------------|----------------|------|------|----------------|--------|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额           | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额           | 份额占比   |
| 机构                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 1              | 2021/3/25-2021/6/30    | 750,032,750.00 | -    | -    | 750,032,750.00 | 30.00% |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                |                        |                |      |      |                |        |
| <p>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：</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。</p> |                |                        |                |      |      |                |        |

### 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瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《南华瑞泰39个月定期开放债券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) 报告期内南华瑞泰39个月定期开放债券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

北京市西城区武定侯街2号泰康国际大厦10层1002-1003单元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.nanhuafoods.com](http://www.nanhuafoods.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  
二〇二一年八月三十日