

南方优选成长混合型证券投资基金 2018 年半年度报告摘要

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 27 日

重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方优选成长混合	
基金主代码	202023	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 1 月 30 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	405,424,981.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方优选成长 A	南方优选成长 C
下属分级基金的交易代码	202023	005206
报告期末下属分级基金的 份额总额	388,758,914.48 份	16,666,067.48 份

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下,可简称为“南方成长”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选高成长性的优质企业进行重点投资,并通过动态的资产配置,增加组合的超额收益,在有效控制市场风险的前提下,力争为投资者寻求长期稳定的资产增值。
投资策略	本基金基于宏观经济环境、微观经济因素、经济周期情况、政策形势和证券市场趋势的综合分析,结合经济周期投资时钟理论,形成对不同市场周期的预测和判断,进行积极、灵活的资产配置,确定组合中股票、债券、现金等资产之间的投资比例。本基金为混合型基金,通过积极分析判断市场趋势,运用战略资产配置策略和风险管理策略,系统化管理各大类资产的配置比例。本基金严谨衡量不同类别资产的预期风险/收益特征,评估股票市场价值,如股票市场价值的整体估值水平偏离企业实际的盈利状况和预期的成长率或预计将出现较大的偏离,本基金将及时降低股票资产配置,或适度增加债券市场的配置权重,避免或减少可能给投资人带来潜在的资本损失。
业绩比较基准	本基金为混合型基金,在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制方法和历史情况后,选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准;债券组合的业绩基准则采用了上证国债指数。因此,本基金的整体业绩比较基准可以表述为如下公式: $60\% \times \text{沪深 300 指数} + 40\% \times \text{上证国债指数}$ 。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险和收益水平高于债券基金及货币市

	场基金，低于股票基金。
--	-------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67595096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	010-67595096
传真		0755-82763889	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§ 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(2018年01月01日-2018年06月30日)		
	南方优选成长 A	南方优选成长 C	
本期已实现收益	7,639,989.28	88,126.57	
本期利润	-56,904,210.67	-2,661,765.40	
加权平均基金份额本期利润	-0.1443	-0.1719	
本期基金份额净值增长率	-5.47%	-5.86%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)		
	期末可供分配基金份额利润	1.4031	1.3924
	期末基金资产净值	934,225,801.11	39,872,156.41
期末基金份额净值	2.403	2.392	

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. 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(为期末余额, 不是当期发生数)。

3. 所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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方优选成长 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.21%	1.19%	-4.46%	0.77%	-0.75%	0.42%
过去三个月	-2.91%	1.09%	-5.43%	0.68%	2.52%	0.41%
过去六个月	-5.47%	1.11%	-6.72%	0.69%	1.25%	0.42%
过去一年	6.75%	0.96%	-1.09%	0.57%	7.84%	0.39%
过去三年	26.01%	1.31%	-8.16%	0.89%	34.17%	0.42%
自基金合同生效起至今	140.30%	1.14%	27.22%	0.87%	113.08%	0.27%

南方优选成长 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	-5.27%	1.19%	-4.46%	0.77%	-0.81%	0.42%
过去三个月	-3.12%	1.09%	-5.43%	0.68%	2.31%	0.41%
过去六个月	-5.86%	1.11%	-6.72%	0.69%	0.86%	0.42%
自基金合同生效起至今	-2.53%	1.09%	-6.24%	0.67%	3.71%	0.42%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方优选成长A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方优选成长C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金 2017 年 11 月 22 日发布公告，增加 C 类收费模式，原有收费模式称为 A 类。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金 3 亿元人民币。目

前股权结构：华泰证券股份有限公司 45%、深圳市投资控股有限公司 30%、厦门国际信托有限公司 15%及兴业证券股份有限公司 10%。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超 8,200 亿元，旗下管理 168 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
骆帅	本基金基金经理	2015 年 6 月 19 日	-	8	清华大学管理科学与工程专业硕士，具有基金从业资格，2009 年 7 月加入南方基金，担任研究部研究员、高级研究员 2014 年 3 月至 2015 年 5 月，任南方成份、南方安心基金经理助理；2015 年 5 月至今，任南方高端装备基金经理；2015 年 6 月至今，任南方价值、南方成长基金经理；2016 年 12 月至今，任南方绩优基金经理

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方优选成长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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%。

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

上半年，A股市场波动率明显提高。国内的去杠杆政策以及国际的贸易摩擦都对市场预期形成了负面影响，市场在一月份短暂的上涨后转入下跌趋势，尤其是进入6月份之后，下跌速度加快。市场对于去杠杆和贸易战的认识较为悲观，进而对经济前景做出负面展望。行业方面分化较大，消费和医药等防御性板块，以及计算机等科技类板块表现良好；偏周期性股票，尤其是地产产业链相关板块下跌较多。报告期内，本基金在权益仓位上处于中等偏高水平；债券仓位保持在20%，以利率债为主；股票配置方面，坚持精选龙头企业，行业配置上以食品饮料、电子、休闲服务、医药生物和家用电器等偏消费类行业为主，适当增大了家居行业配置。行业风格上，以大盘和中盘成长风格为主，更看重公司的盈利增长的持续性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金A级净值增长率为-5.47%，同期业绩比较基准收益率为-6.72%。本报告期基金C级净值增长率为-5.86%，同期业绩比较基准收益率为-6.72%。。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为中国经济新旧动能转换依旧是市场主旋律，从房地产、基建为主导的模式转向以高端制造、科技创新和消费升级为主导的模式，一方面继续去杠杆、抑制房地产价格泡

沫，另一方面加大改革、创新力度，加快转型和结构升级。但鉴于上半年的经济表现以及部分风险的暴露，去杠杆在坚定方向的同时，节奏上可能更加稳健。央行货币政策表述转向“合理充裕”，也代表了货币上边际宽松的倾向。当前的市场估值，已经到了合理偏低的区间，无论是从历史纵向对比，还是从 FED 模型的股债收益比角度，下跌空间已十分有限，很多行业龙头性价比凸显。我们对中国经济的增长潜力保持乐观，在市场情绪最为低迷的时候，往往也是最有利于中长期投资布局的时候。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，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分配收益将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方优选成长混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	50,410,738.00	7,240,998.58
结算备付金		11,896,897.13	13,237,421.88
存出保证金		366,218.33	204,439.81
交易性金融资产	6.4.4.2	914,296,319.59	806,042,171.24
其中：股票投资		720,596,519.49	627,686,499.44
基金投资		-	-
债券投资		193,699,800.10	178,355,671.80
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		-	3,496,119.44
应收利息	6.4.4.5	4,222,923.43	3,720,702.77
应收股利		-	-
应收申购款		10,974,040.91	7,484,743.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		992,167,137.39	841,426,596.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		14,126,770.82	3,252,416.60
应付赎回款		1,530,464.20	1,530,925.27
应付管理人报酬		1,225,099.14	1,022,010.33
应付托管费		204,183.22	170,335.06
应付销售服务费		27,274.39	21.10
应付交易费用	6.4.4.7	665,252.51	1,088,318.43
应交税费		112.04	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	290,023.55	458,428.50
负债合计		18,069,179.87	7,522,455.29
所有者权益:			
实收基金	6.4.4.9	405,424,981.96	328,023,187.72
未分配利润	6.4.4.10	568,672,975.56	505,880,953.90
所有者权益合计		974,097,957.52	833,904,141.62
负债和所有者权益总计		992,167,137.39	841,426,596.91

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 405,424,981.96 份，其中南方优选成长混合型证券投资基金 A 类基金份额的份额总额为 388,758,914.48 份，基金份额净值 2.403 元；南方优选成长混合型证券投资基金 C 类基金份额的份额总额为 16,666,067.48 份，基金份额净值 2.392 元。

6.2 利润表

会计主体：南方优选成长混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-47,267,554.73	80,680,664.94
1. 利息收入		3,862,319.22	2,017,316.10
其中：存款利息收入	6.4.4.11	322,314.40	264,026.50
债券利息收入		3,540,004.82	1,753,289.60
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）		15,656,879.01	20,274,554.20
其中：股票投资收益	6.4.4.12	7,706,141.75	16,915,738.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	161,837.62	5,572.98
资产支持证券投资收益	6.4.4.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.4.14	-	-
衍生工具收益	6.4.4.15	-	-
股利收益	6.4.4.16	7,788,899.64	3,353,243.02
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.4.17	-67,294,091.92	58,355,351.81
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.4.18	507,338.96	33,442.83
减：二、费用		12,298,421.34	5,738,605.65
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	7,643,016.57	3,690,061.62
2. 托管费	6.4.7.2.2	1,273,836.08	615,010.30
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	154,418.56	-
4. 交易费用	6.4.4.19	3,014,673.51	1,230,836.92
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		41.12	-
7. 其他费用	6.4.4.20	212,435.50	202,696.81
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-59,565,976.07	74,942,059.29
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-59,565,976.07	74,942,059.29
-------------------	--	----------------	---------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方优选成长混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	328,023,187.72	505,880,953.90	833,904,141.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-59,565,976.07	-59,565,976.07
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）	77,401,794.24	122,357,997.73	199,759,791.97
其中：1. 基金申购款	244,361,294.16	373,582,859.75	617,944,153.91
2. 基金赎回款	-166,959,499.92	-251,224,862.02	-418,184,361.94
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）	405,424,981.96	568,672,975.56	974,097,957.52
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	211,948,577.11	200,335,967.43	412,284,544.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	74,942,059.29	74,942,059.29
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）	69,876,954.30	77,417,208.87	147,294,163.17
其中：1. 基金申购款	93,446,932.98	103,161,236.03	196,608,169.01
2. 基金赎回款	-23,569,978.68	-25,744,027.16	-49,314,005.84
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）	281,825,531.41	352,695,235.59	634,520,767.00

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：

<u>杨小松</u>	<u>徐超</u>	<u>徐超</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以

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

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(d) 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。

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

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司（“南方基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于 2018 年 1 月 4 日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
兴业证券	32,454,013.54	1.58	212,888,359.79	25.61
华泰证券	-	-	-	-

6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
华泰证券	0.00	0.00	0.00	0.00
兴业证券	0.00	0.00	0.00	0.00

6.4.6.1.3 债券回购交易

注:无。

6.4.6.1.4 权证交易

注:无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
兴业证券	29,575.48	1.58	29,575.48	4.45
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
兴业证券	194,005.29	25.50	194,005.29	12.69
华泰证券	0.00	0.00	0.00	0.00

注: 1. 上述佣金按市场佣金率计算, 以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。 2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年 6月30日	2017年1月1日至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,643,016.57	3,690,061.62
其中: 支付销售机构的客户维护费	1,351,193.55	901,224.14

注: 支付基金管理人南方基金管理股份有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为: $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年 6月30日	2017年1月1日至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,273,836.08	615,010.30

注: 支付基金托管人中国建设银行的托管费按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。其计算公式为: $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方优选成长 A	南方优选成长 C	合计
南方基金	-	151,982.83	151,982.83
合计	-	151,982.83	151,982.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方优选成长 A	南方优选成长 C	合计
南方基金	-	-	-
合计	-	-	-

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:无。

6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:无。

6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	50,410,738.00	255,026.06	74,227,489.65	212,694.10

注:本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-

6.4.7.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大资产重组	6.00	-	-	22	139.04	132.00	-
603386	广东骏亚	2018-06-19	拟筹划重大资产重组	23.49	-	-	44	274.12	1,033.56	-
603939	益丰	2018-04-17	拟筹	59.72	2018-07-16	65.69	176,514	7,898,847.00	10,541,416.08	-

	药房		划重大资产重组						
--	----	--	---------	--	--	--	--	--	--

6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注: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	720,596,519.49	72.63
	其中:股票	720,596,519.49	72.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	193,699,800.10	19.52
	其中:债券	193,699,800.10	19.52
	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	62,307,635.13	6.28
8	其他各项资产	15,563,182.67	1.57
9	合计	992,167,137.39	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	584.66	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	479,669,546.99	49.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,541.52	0.00
E	建筑业	1,967.42	0.00
F	批发和零售业	24,771,169.71	2.54

G	交通运输、仓储和邮政业	3,930,727.11	0.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,734,139.87	0.59
J	金融业	66,288,532.15	6.81
K	房地产业	31,828,936.00	3.27
L	租赁和商务服务业	77,295,611.12	7.94
M	科学研究和技术服务业	875.81	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	30,967,451.99	3.18
R	文化、体育和娱乐业	1,209.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	720,596,519.49	73.98

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601888	中国国旅	953,600	61,421,376.00	6.31
2	600872	中炬高新	1,917,806	53,698,568.00	5.51
3	002415	海康威视	1,387,000	51,499,310.00	5.29
4	000786	北新建材	2,649,919	49,102,999.07	5.04
5	600519	贵州茅台	65,816	48,141,771.36	4.94
6	000333	美的集团	813,700	42,491,414.00	4.36
7	603515	欧普照明	705,547	32,977,266.78	3.39
8	601318	中国平安	538,300	31,533,614.00	3.24
9	601012	隆基股份	1,747,540	29,166,442.60	2.99
10	600887	伊利股份	1,022,476	28,527,080.40	2.93

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.nffund.com> 的半年度报告正文。

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	002027	分众传媒	63,718,729.05	7.64
2	000333	美的集团	62,930,713.88	7.55
3	002415	海康威视	59,145,597.07	7.09
4	600036	招商银行	50,002,089.66	6.00
5	600887	伊利股份	42,704,551.72	5.12
6	600519	贵州茅台	38,969,187.97	4.67
7	601012	隆基股份	38,563,758.04	4.62
8	000786	北新建材	34,045,170.80	4.08
9	601398	工商银行	33,646,749.36	4.03
10	603833	欧派家居	31,698,106.44	3.80
11	000002	万科A	29,995,165.06	3.60
12	300308	中际旭创	27,047,013.57	3.24
13	601888	中国国旅	23,310,772.41	2.80
14	600004	白云机场	22,717,916.97	2.72
15	300015	爱尔眼科	20,285,261.71	2.43
16	001979	招商蛇口	19,777,191.65	2.37
17	000858	五粮液	19,518,685.00	2.34
18	601166	兴业银行	19,147,828.00	2.30
19	002142	宁波银行	18,024,593.00	2.16
20	000977	浪潮信息	17,885,197.94	2.14
21	603515	欧普照明	17,835,846.64	2.14
22	300059	东方财富	17,457,656.23	2.09

注:买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	002027	分众传媒	56,463,455.01	6.77
2	600036	招商银行	49,360,116.14	5.92
3	600887	伊利股份	31,110,914.75	3.73
4	601318	中国平安	30,646,470.72	3.68
5	002202	金风科技	29,518,748.09	3.54
6	300015	爱尔眼科	28,533,520.77	3.42
7	600867	通化东宝	25,186,505.54	3.02
8	300308	中际旭创	24,612,107.08	2.95
9	600702	沱牌舍得	24,559,749.04	2.95
10	000998	隆平高科	24,292,354.07	2.91
11	603515	欧普照明	23,717,133.29	2.84

12	000002	万 科 A	22,603,433.27	2.71
13	603288	海天味业	21,347,447.82	2.56
14	601888	中国国旅	21,341,367.27	2.56
15	000858	五 粮 液	20,323,538.36	2.44
16	600066	宇通客车	20,184,486.08	2.42
17	000977	浪潮信息	19,966,102.80	2.39
18	600004	白云机场	18,989,325.81	2.28
19	600438	通威股份	18,562,986.72	2.23
20	601766	中国中车	18,234,058.08	2.19
21	601166	兴业银行	18,103,705.00	2.17
22	601398	工商银行	17,626,043.72	2.11
23	300059	东方财富	16,893,287.59	2.03
24	002142	宁波银行	16,812,429.43	2.02

注:卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	1,107,082,488.58
卖出股票收入(成交)总额	954,124,111.06

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	189,483,000.00	19.45
	其中:政策性金融债	189,483,000.00	19.45
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)	4,216,800.10	0.43
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	193,699,800.10	19.89

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	170410	17 农发 10	700,000	70,021,000.00	7.19
2	180404	18 农发 04	600,000	60,180,000.00	6.18
3	180201	18 国开 01	300,000	30,090,000.00	3.09
4	160207	16 国开 07	200,000	19,192,000.00	1.97
5	170207	17 国开 07	100,000	10,000,000.00	1.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注: 本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

7.10.1 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。基金管理人建立了股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 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	366,218.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,222,923.43
5	应收申购款	10,974,040.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,563,182.67

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113015	隆基转债	3,961,600.00	0.41

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
南方优选成长A	50,472	7,702.47	142,534,262.59	36.66	246,224,651.89	63.34
南方	323	51,597.73	16,462,285.94	98.78	203,781.54	1.22

优选成长 C						
合计	50,795	7,981.59	158,996,548.53	39.22	246,428,433.43	60.78

注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方优选成长 A	1,548,492.52	0.3983
	南方优选成长 C	-	-
	合计	1,548,492.52	0.3819

注:分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	南方优选成长 A	10~50
	南方优选成长 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	南方优选成长 A	-
	南方优选成长 C	-
	合计	-

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	南方优选成长 A	南方优选成长 C
基金合同生效日 (2011年1月30日)基金份额总额	2,216,873,965.77	-
本报告期期初基金份额总额	327,972,220.84	50,966.88

本报告期基金总申购份额	227,024,364.18	17,336,929.98
减：本报告期基金总赎回份额	166,237,670.54	721,829.38
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	388,758,914.48	16,666,067.48

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民族证券	1	367,015,700.99	17.82%	334,462.39	17.82%	-

国金证券	1	330,277,39 1.96	16.04%	300,980.82	16.04%	-
安信证券	1	275,367,35 3.45	13.37%	250,941.66	13.37%	-
招商证券	1	265,322,32 3.86	12.88%	241,788.25	12.88%	-
银河证券	1	233,981,96 5.72	11.36%	213,219.25	11.36%	-
国泰君安	1	196,126,95 6.59	9.52%	178,730.47	9.52%	-
中金公司	1	158,472,73 7.76	7.69%	144,416.41	7.69%	-
中泰证券	1	126,667,41 8.23	6.15%	115,429.70	6.15%	-
诚浩证券	1	73,793,691 .29	3.58%	67,248.14	3.58%	-
兴业证券	1	32,454,013 .54	1.58%	29,575.48	1.58%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
诚浩证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
国金证券	249,000.00	4.70%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	5,044,506.80	95.30%	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注:无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。