

南方中证互联网指数分级证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 03 月 27 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 25 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方中证互联网指数分级		
场内简称	互联基金		
基金主代码	160137		
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）		
基金合同生效日	2015 年 7 月 1 日		
基金管理人	南方基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	166,566,187.52 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 7 月 13 日		
下属分级基金的基金简称	南方中证互联网指数分级	互联 A 级	互联 B 级
下属分级基金的场内简称	互联基金	互联 A 级	互联 B 级
下属分级基金的交易代码	160137	150297	150298
报告期末下属分级基金的份额总额	161,271,843.52 份	2,647,172.00 份	2,647,172.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，

	或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。		
业绩比较基准	中证互联网指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。		
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。	互联网 A 份额为稳健收益类份额，具有低预期风险且预期收益相对较低的特征。	互联网 B 份额为积极收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	常克川	贺倩
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-68121816

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018 年	2017 年	2016 年
---------------	--------	--------	--------

本期已实现收益	-11,600,892.41	7,988,005.75	-22,044,934.56
本期利润	-63,063,713.44	36,009,995.88	-64,153,808.69
加权平均基金份额本期利润	-0.2704	0.1052	-0.1452
本期基金份额净值增长率	-29.50%	14.53%	-19.79%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.5378	-0.1144	-0.2236
期末基金资产净值	144,288,200.06	233,049,169.19	292,096,861.72
期末基金份额净值	0.8663	0.8023	0.7242

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。

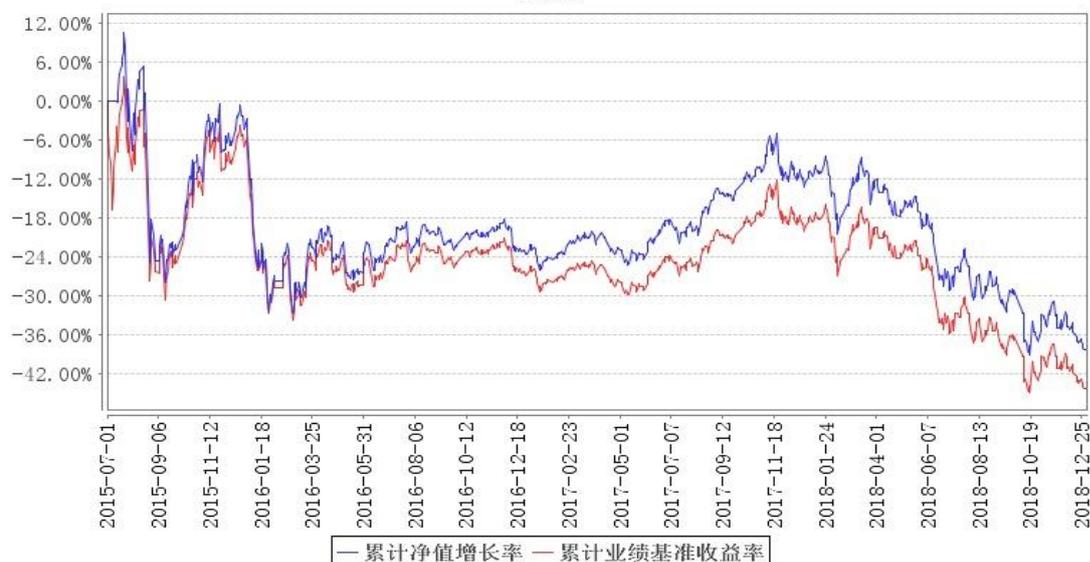
3.2 基金净值表现

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

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
过去三个月	-12.82%	1.86%	-12.66%	1.86%	-0.16%	0.00%
过去六个月	-16.71%	1.69%	-17.02%	1.69%	0.31%	0.00%
过去一年	-29.50%	1.57%	-30.87%	1.57%	1.37%	0.00%
过去三年	-35.24%	1.45%	-39.69%	1.41%	4.45%	0.04%
自基金合同生效起至今	-38.30%	1.70%	-44.25%	1.70%	5.95%	0.00%

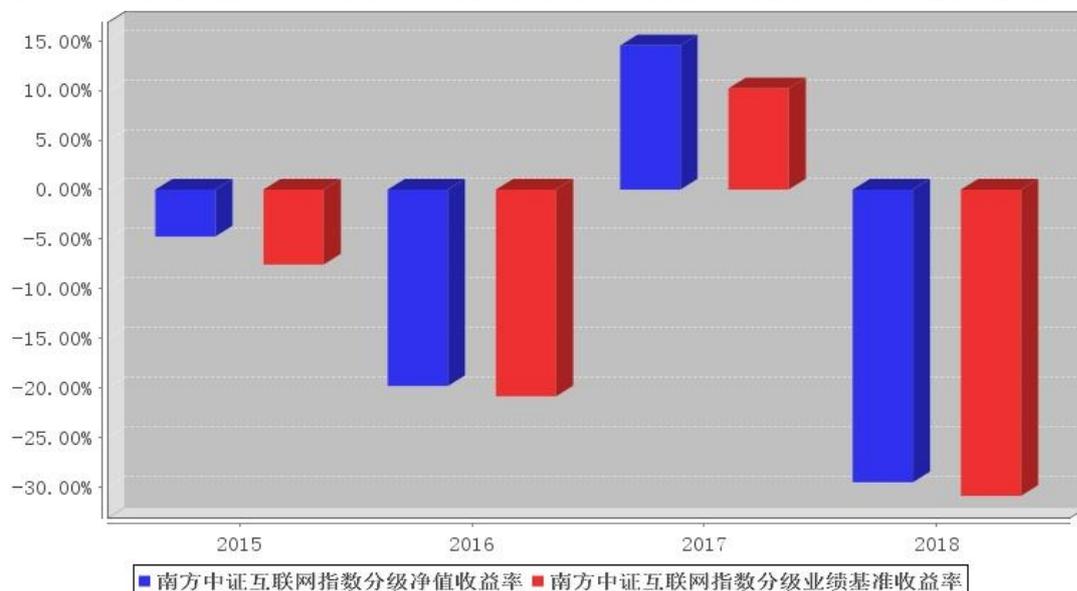
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方中证互联网指数分级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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证互联网指数分级基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:基金合同生效当年按实际存续期计算, 不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:无。

§ 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、南京等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模近 8,300 亿元，旗下管理 178 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		
周豪	本基金基金 经理	2016年8月19 日	-	10	北京大学软件工程专业硕士，具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金信息技术部，长期负责指数基金及ETF基金的投研及系统支持工作；2015年6月，任数量化投资部高级研究员；2018年2月至2018年11月，任南方消费活力基金经理；2016年4月至今，任500工业ETF、500原材料ETF基金经理；2016年8月至今，任380ETF、南方380、小康ETF、南方小康、互联基金基金经理；2016年9月至今，任1000ETF基金经理；2017年8月至今，任南方有色金属基金经理；2017年9月至今，任南方有色金

					属联接基金经理；2018 年 1 月至今，任南方中证 100 基金经理。
--	--	--	--	--	--------------------------------------

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定,针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动,以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节,建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则,投资管理制度和细则,集中交易管理办法,公平交易操作指引,异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制,完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估,以及履行相关的报告和信息披露义务,切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为,保护投资者合法权益。

4.3.2 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,两两组合同单日、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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 7 次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及投资组合的投资策略需要所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数分级基金，在基础份额之外，还设计了配比为 1:1 的互联 A 级和互联 B 级两类子份额，并于深交所上市。上市交易的开放式基金都存在两套价格体系，分别是上市价格体系和净值价格体系，两者之间折溢价关系的明确可预期是交易型投资者的基础需求，长期配置型投资者（主要为场外份额投资者）也希望通过投资本基金获取贴近指数的投资回报。所以，我们一直致力于为投资者提供准确、透明的指数化投资工具，不管遭遇市场剧烈波动、大额申赎还是不定期折算，都始终坚守被动投资理念，力争将投资中的主动判断和操作降至最低限度，更不会主动进行大幅增减仓操作。我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：（1）接受申购赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；（2）报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离。（3）根据指数每半年度成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.8663 元，报告期内，份额净值增长率为-29.50%，同期业绩基准增长率为-30.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年，在去杠杆、防风险大背景下，经济下行压力较大，同时外部受中美贸易冲突加剧影响，A 股市场整体表现不佳，主要股指均大幅回落。展望 2019 年，仍需重点关注经济下行情况，另一方面，当前 A 股估值整体处于历史低位，如外部环境好转，预计会有较好表现，建议关注其中长期配置价值。本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在存续期内，本基金（包括南方互联网份额、互联网 A 份额、互联网 B 份额）不进行收益分配；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

本基金 2018 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2019)第 23063 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方中证互联网指数分级证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	3,153,817.79	12,519,114.39
结算备付金		71,105.90	64,602.87
存出保证金		5,378.75	25,014.47
交易性金融资产	7.4.7.2	141,473,630.45	221,393,570.52
其中：股票投资		136,451,630.45	221,393,570.52
基金投资		-	-
债券投资		5,022,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	677,418.91
应收利息	7.4.7.5	140,500.10	2,583.09
应收股利		-	-
应收申购款		71,930.44	18,621.01
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		144,916,363.43	234,700,925.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		62,817.26	994,833.97
应付管理人报酬		127,261.60	202,162.22
应付托管费		27,997.53	44,475.69
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,854.34	6,162.63
应交税费		2.43	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	404,230.21	404,121.56
负债合计		628,163.37	1,651,756.07
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	233,867,569.94	266,288,306.76
未分配利润	7.4.7.10	-89,579,369.88	-33,239,137.57
所有者权益合计		144,288,200.06	233,049,169.19
负债和所有者权益总计		144,916,363.43	234,700,925.26

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 166,566,187.52 份，其中南方中证互联网指数分级证券投资基金之基础份额的份额总额为 161,271,843.52 份，基金份额净值 0.8663 元；南方中证互联网指数分级证券投资基金之 A 份额的份额总额为 2,647,172.00 份，基金份额参考净值 1.0220 元；南方中证互联网指数分级证券投资基金之 B 份额的份额总额为 2,647,172.00 份，基金份额参考净值 0.7106 元。

7.2 利润表

会计主体：南方中证互联网指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
一、收入		-60,041,909.78	40,034,992.84
1. 利息收入		113,325.35	285,005.82

其中：存款利息收入	7.4.7.11	73,383.08	116,909.46
债券利息收入		39,942.27	20.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	168,075.88
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-8,737,130.99	11,638,291.68
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-10,843,067.66	9,314,153.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-9,583.18	-70.40
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,115,519.85	2,324,208.92
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-51,462,821.03	28,021,990.13
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	44,716.89	89,705.21
减：二、费用		3,021,803.66	4,024,996.96
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,895,015.14	2,635,806.82
2. 托管费	7.4.10.2.2	416,903.42	579,877.51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	92,327.46	185,004.14
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.25	-
7. 其他费用	7.4.7.20	617,557.39	624,308.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-63,063,713.44	36,009,995.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-63,063,713.44	36,009,995.88

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证互联网指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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)	266,288,306.76	-33,239,137.57	233,049,169.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-63,063,713.44	-63,063,713.44
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)	-32,420,736.82	6,723,481.13	-25,697,255.69
其中：1. 基金申购款	27,804,939.98	-5,964,376.38	21,840,563.60
2. 基金赎回款	-60,225,676.80	12,687,857.51	-47,537,819.29
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)	233,867,569.94	-89,579,369.88	144,288,200.06
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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)	382,267,174.11	-90,170,312.39	292,096,861.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	36,009,995.88	36,009,995.88
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)	-115,978,867.35	20,921,178.94	-95,057,688.41
其中：1. 基金申购款	18,514,408.27	-3,182,529.01	15,331,879.26

2. 基金赎回款	-134,493,275.62	24,103,707.95	-110,389,567.67
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）	266,288,306.76	-33,239,137.57	233,049,169.19

注：-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松

徐超

徐超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方中证互联网指数分级证券投资基金(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[2015]887号《关于准予南方中证互联网指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司,已于2018年1月4日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证互联网指数分级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基金,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611,691,590.41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(2015)第792号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证互联网指数分级证券投资基金基金合同》于2015年7月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为611,872,014.42份基金份额,其中认购资金利息折合180,773.01份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《南方中证互联网指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的基金份额包括南方中证互联网指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“南方互联网份额”)、南方中证互联网指数分级证券投资基金之A份额(以下简称“互联网A份额”)及南方中证互联网指数分级证券投资基金之B份额(以下简称“互联网B份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售南方互联网份额。投资人场外认购所得的南方互联网份额,不进行自动分离或分拆。投资人场内认

购所得的南方互联网份额，将按 1：1 的基金份额配比自动分离为互联网 A 份额和互联网 B 份额。互联网 A 份额和互联网 B 份额的数量保持 1：1 的比例不变。基金合同生效后，南方互联网份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下，互联网 A 份额和互联网 B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内南方互联网份额与互联网 A 份额和互联网 B 份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换，包括包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内南方互联网份额按照 1：1 的份额配比转换成 1 份互联网 A 份额与 1 份互联网 B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份互联网 A 份额与 1 份互联网 B 份额按照 1：1 的基金份额配比转换成 2 份场内南方互联网份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：南方互联网份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为南方互联网份额、互联网 A 份额和互联网 B 份额数量的总和。本基金每份互联网 A 份额与每份互联网 B 份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份南方互联网份额的基金份额净值之和。互联网 A 份额的约定收益率为人民币一年期银行定期存款利率(税后)+4.0%。互联网 A 份额的份额净值每日按该约定收益率逐日计算，计算出互联网 A 份额的基金份额参考净值后，根据南方互联网份额的基金份额净值与互联网 A 份额、互联网 B 份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出互联网 B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每年 12 月 1 日(若该日为非工作日，则顺延至下一个工作日；基金合同生效不足 6 个月的除外)，本基金将进行基金的定期份额折算：定期份额折算后互联网 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元，基金份额折算基准日折算前互联网 A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为场内南方互联网份额分配给互联网 A 份额持有人。南方互联网份额持有人持有的每 2 份南方互联网份额将按 1 份互联网 A 份额获得新增南方互联网份额的分配。持有场外南方互联网份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外南方互联网份额的分配；持有场内南方互联网份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内南方互联网份额的分配。经过上述份额折算后，南方互联网份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，互联网 A 份额和互联网 B 份额的份额配比保持 1：1 的比例。互联网 B 份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变互联网 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外，当南方互联网份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，或当互联网 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，本基金将以该日后的次一交易日为本基

金不定期折算基准日，进行不定期份额折算：份额折算后本基金将确保互联网 A 份额和互联网 B 份额的比例为 1:1，份额折算后互联网 A 份额的基金份额参考净值、互联网 B 份额的基金份额参考净值和南方互联网份额的基金份额净值均调整为 1.0000 元。当南方互联网份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，基金份额折算基准日折算前南方互联网份额的基金份额净值及互联网 A 份额、互联网 B 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分均将折算为南方互联网份额分别分配给南方互联网份额、互联网 A 份额和互联网 B 份额的持有人。当互联网 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，南方互联网份额、互联网 A 份额和互联网 B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]338 号核准，本基金互联网 A 份额 55,638,584 份基金份额与互联网 B 份额 55,638,585 份基金份额于 2015 年 7 月 13 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的南方互联网份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为互联网 A 份额和互联网 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的南方互联网份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为互联网 A 份额和互联网 B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证互联网指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。此外，本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具。本基金 80%以上的基金资产投资于股票，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证互联网指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2019 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方中证互联网指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

7.4.6 重要财务报表项目的说明

7.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	3,153,817.79	12,519,114.39
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	3,153,817.79	12,519,114.39

7.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	187,497,735.08	136,451,630.45	-51,046,104.63

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	5,023,000.00	5,022,000.00	-1,000.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	5,023,000.00	5,022,000.00	-1,000.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	192,520,735.08	141,473,630.45	-51,047,104.63	
项目	上年度末 2017年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	220,977,854.12	221,393,570.52	415,716.40	
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	220,977,854.12	221,393,570.52	415,716.40	

7.4.6.3 衍生金融资产/负债

注:无。

7.4.6.4 买入返售金融资产

注:无。

7.4.6.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	651.42	2,536.77
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	38.06	35.02
应收债券利息	139,808.22	-
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	2.40	11.30

合计	140,500.10	2,583.09
----	------------	----------

7.4.6.6 其他资产

注:无。

7.4.6.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	5,854.34	6,162.63
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	5,854.34	6,162.63

7.4.6.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	230.21	121.56
预提费用	354,000.00	354,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	404,230.21	404,121.56

7.4.6.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	290,475,669.73	266,288,306.76
本期申购	20,980,455.88	19,233,378.19
本期赎回(以“-”号填列)	-43,376,977.31	-39,765,104.40
2018年08月07日基金拆分/份额折算前	268,079,148.30	245,756,580.55
基金拆分/份额折算调整	-93,045,382.28	-
本期申购	6,104,865.69	8,571,561.79
本期赎回(以“-”号填列)	-14,572,444.19	-20,460,572.40
本期末	166,566,187.52	233,867,569.94

注:1. 申购含配对转入份额; 赎回含配对转出份额。

2. 根据《南方中证互联网指数分级证券投资基金基金合同》和南方基金管理股份有限公司于2018年8月9日发布的《关于南方中证互联网指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复

交易的公告》，本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以 2018 年 8 月 7 日为份额折算基准日，对南方互联网份额的场外份额、场内份额、互联网 A 份额以及互联网 B 级份额实施不定期份额折算。折算前，南方互联网份额的场外份额和场内份额分别为 244,402,294.30 份和 3,317,537.00 份，根据基金份额折算公式，份额折算比例为 0.652918253，折算后南方互联网份额的场外份额总额和场内份额总额分别为 159,574,719.02 份和 2,166,080.00 份，南方互联网份额净值为 1.0000 元；根据基金合同规定，折算后互联网 A 份额与互联网 B 份额的份额配比保持 1:1 不变原则。折算前，互联网 A 份额为 10,179,658.00 份，以份额折算比例 0.268315959 折算后互联网 A 份额总额为 2,731,364.00 份，以份额折算比例 0.769204588 折算后产生新增南方互联网份额的场内份额 7,830,239.00 份，互联网 A 份额净值为 1.0000 元。折算前，互联网 B 份额为 10,179,659.00 份，根据基金份额折算公式，份额折算比例为 0.268315959，折算后互联网 B 份额总额为 2,731,364.00 份，互联网 B 份额净值为 1.0000 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的南方互联网份额、互联网 A 份额、互联网 B 份额进行了折算，并于 2018 年 8 月 7 日进行了变更登记。

3. 根据《南方中证互联网指数分级证券投资基金基金合同》中关于基金份额折算特殊情形处理的相关约定，基金合同生效日或不定期折算基准日至当年的基金份额定期折算基准日不满 6 个月的，本基金不进行定期折算。

4. 截至 2018 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 5,294,344.00 份，其中互联网 A 份额为 2,647,172.00 份、互联网 B 份额为 2,647,172.00 份；托管在深交所场内未上市的基金份额为 3,254,228.00 份，托管在场外未上市的基金份额为 158,017,615.52 份，均为南方互联网份额(2017 年 12 月 31 日：于深交所上市的基金份额为 27,708,532.00 份，其中互联网 A 份额为 13,854,266.00 份、互联网 B 份额为 13,854,267.00 份；托管在深交所场内未上市的基金份额为 3,391,810.00 份，托管在场外未上市的基金份额为 259,375,326.73 份，均为南方互联网份额)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。南方互联份额与互联网 A 份额、互联网 B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。

7.4.6.10 未分配利润

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
上年度末	-22,744,443.29	-10,494,694.28	-33,239,137.57
本期利润	-11,600,892.41	-51,462,821.03	-63,063,713.44
本期基金份额交易产生的变动数	3,269,834.27	3,453,646.86	6,723,481.13

其中：基金申购款	-2,886,478.70	-3,077,897.68	-5,964,376.38
基金赎回款	6,156,312.97	6,531,544.54	12,687,857.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-31,075,501.43	-58,503,868.45	-89,579,369.88

7.4.6.11 存款利息收入

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12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	71,374.21	54,048.99
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	1,715.73	62,380.70
其他	293.14	479.77
合计	73,383.08	116,909.46

7.4.6.12 股票投资收益

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12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
卖出股票成交总额	70,506,214.31	148,062,948.93
减：卖出股票成本总额	81,349,281.97	138,748,795.77
买卖股票差价收入	-10,843,067.66	9,314,153.16

7.4.6.13 债券投资收益

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12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	144,390.04	78,350.08
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	153,900.00	78,400.00
减：应收利息总额	73.22	20.48
买卖债券差价收入	-9,583.18	-70.40

7.4.6.14 贵金属投资收益

注：无。

7.4.6.15 衍生工具收益

注:无。

7.4.6.16 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,115,519.85	2,324,208.92
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,115,519.85	2,324,208.92

7.4.6.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-51,462,821.03	28,021,990.13
股票投资	-51,461,821.03	28,021,990.13
债券投资	-1,000.00	-
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	-51,462,821.03	28,021,990.13

7.4.6.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
基金赎回费收入	44,716.89	89,705.21
其他	-	-
合计	44,716.89	89,705.21

注:本基金的场外赎回费率按持有期间递减,场内赎回费率为赎回金额的0.5%,赎回费总额的25%归入基金资产。

7.4.6.19 交易费用

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 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	92,327.46	185,004.14
银行间市场交易费用	-	-
合计	92,327.46	185,004.14

7.4.6.20 其他费用

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 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	54,000.00	54,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
账户维护费	-	50.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
银行费用	3,557.39	10,208.49
上市费	60,000.00	60,000.00
其他	-	50.00
合计	617,557.39	624,308.49

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币 50,000.00 元。

7.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.7.1 或有事项

无。

7.4.7.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.8 关联方关系

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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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	基金管理人的股东、基金销售机构

厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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 (%)
华泰证券	69,490,546.75	60.12	120,117,851.64	61.37

7.4.9.1.2 权证交易

注:无。

7.4.9.1.3 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12月31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 (%)
华泰证券	6,949.79	60.13	3,196.83	54.61
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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 (%)
华泰证券	12,011.62	61.37	3,762.22	61.05

注:1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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。

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 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12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,895,015.14	2,635,806.82
其中：支付销售机构的客户维护费	700,448.86	887,810.22

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 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 × 1.00% / 当年天数。

7.4.9.2.2 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12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	416,903.42	579,877.51

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% / 当年天数。

7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

注：无。

7.4.9.5 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	3,153,817.79	71,374.21	12,519,114.39	54,048.99

注：本基金由基金托管人中国农业银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.10 利润分配情况

注：无

7.4.11 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.11.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601860	紫金银行	2018-12-21	2019-01-03	新股未上市	3.14	3.14	1,000	3,140.00	3,140.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.11.2 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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000540	中天金融	2017-08-21	重大资产重组	2.72	2019-01-02	4.38	378,600	2,105,102.11	1,029,792.00	-
002183	怡亚通	2018-12-25	拟披露重大事项	5.01	2019-01-02	4.96	118,200	1,358,579.65	592,182.00	-

注：本基金截至 2018 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注:无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	136,451,630.45	94.16
	其中:股票	136,451,630.45	94.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,022,000.00	3.47
	其中:债券	5,022,000.00	3.47
	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	3,224,923.69	2.23
8	其他各项资产	217,809.29	0.15
9	合计	144,916,363.43	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	54,291,827.84	37.63
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	8,248,931.34	5.72
G	交通运输、仓储和邮政业	2,425,454.00	1.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,053,791.10	34.69

J	金融业	7,079,259.00	4.91
K	房地产业	1,928,627.28	1.34
L	租赁和商务服务业	4,697,195.68	3.26
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	1,188,450.00	0.82
R	文化、体育和娱乐业	5,500,420.01	3.81
S	综合	-	-
	合计	135,413,956.25	93.85

8.2.2 报告期末积极投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	720.00	0.00
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	-	-
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	-	-
J	金融业	7,162.20	0.01
K	房地产业	1,029,792.00	0.71
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	-	-
R	文化、体育和娱乐	-	-

	业		
S	综合	-	-
	合计	1,037,674.20	0.72

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 期末指数投资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	002415	海康威视	265,325	6,834,772.00	4.74
2	601318	中国平安	114,400	6,417,840.00	4.45
3	000725	京东方 A	1,882,300	4,950,449.00	3.43
4	600050	中国联通	740,400	3,827,868.00	2.65
5	000063	中兴通讯	189,220	3,706,819.80	2.57
6	300059	东方财富	287,741	3,481,666.10	2.41
7	002027	分众传媒	583,752	3,058,860.48	2.12
8	002024	苏宁易购	296,200	2,917,570.00	2.02
9	002230	科大讯飞	116,478	2,870,017.92	1.99
10	002475	立讯精密	196,393	2,761,285.58	1.91

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> 的年度报告正文。

8.3.2 期末积极投资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	000540	中天金融	378,600	1,029,792.00	0.71
2	601860	紫金银行	1,000	3,140.00	0.00
3	601166	兴业银行	100	1,494.00	0.00
4	000001	平安银行	140	1,313.20	0.00
5	002385	大北农	225	720.00	0.00
6	601555	东吴证券	100	670.00	0.00
7	601998	中信银行	100	545.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002352	顺丰控股	1,624,334.00	0.70
2	002027	分众传媒	1,597,169.47	0.69
3	002415	海康威视	1,208,441.61	0.52
4	601360	三六零	1,158,776.00	0.50
5	601138	工业富联	1,157,562.00	0.50
6	000725	京东方 A	932,906.00	0.40
7	002475	立讯精密	926,906.70	0.40
8	300413	芒果超媒	926,191.20	0.40
9	000100	TCL 集团	909,545.00	0.39
10	300271	华宇软件	742,263.45	0.32
11	600050	中国联通	663,652.00	0.28
12	300059	东方财富	630,484.00	0.27
13	002376	新北洋	622,132.00	0.27
14	002512	达华智能	610,819.00	0.26
15	002120	韵达股份	601,496.00	0.26
16	002419	天虹股份	590,718.00	0.25
17	000063	中兴通讯	578,381.00	0.25
18	002468	申通快递	575,055.00	0.25
19	600859	王府井	567,988.31	0.24
20	600410	华胜天成	564,293.00	0.24

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。

8.4.2 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	601166	兴业银行	10,473,777.51	4.49
2	000001	平安银行	6,985,354.00	3.00
3	601318	中国平安	3,273,830.63	1.40
4	002415	海康威视	2,269,854.00	0.97
5	300003	乐普医疗	2,045,344.40	0.88
6	601607	上海医药	1,652,984.74	0.71
7	601998	中信银行	1,370,203.60	0.59
8	601555	东吴证券	1,329,093.00	0.57
9	600109	国金证券	1,234,826.00	0.53
10	000725	京东方 A	1,167,320.00	0.50
11	002081	金螳螂	1,153,236.00	0.49

12	300104	乐视网	1,091,437.20	0.47
13	601216	君正集团	1,043,090.00	0.45
14	000050	深天马 A	844,515.89	0.36
15	000547	航天发展	785,806.00	0.34
16	000979	中弘股份	729,271.00	0.31
17	600572	康恩贝	619,187.00	0.27
18	300010	立思辰	605,189.00	0.26
19	002027	分众传媒	590,002.00	0.25
20	600158	中体产业	584,289.40	0.25

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。

8.4.3 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	47,869,162.93
卖出股票收入（成交）总额	70,506,214.31

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。

8.5 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	5,022,000.00	3.48
	其中：政策性金融债	5,022,000.00	3.48
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	5,022,000.00	3.48

8.6 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	018005	国开 1701	50,000	5,022,000.00	3.48

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

8.10.2 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,将根据风险管理原则,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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形**

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	5,378.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	140,500.10
5	应收申购款	71,930.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	217,809.29

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000540	中天金融	1,029,792.00	0.71	重大事项停牌
2	601860	紫金银行	3,140.00	0.00	新股未上市

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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（%）
南方中证互联网指数分级	8,668	18,605.43	141,085.79	0.09	161,130,757.73	99.91
互联 A 级	86	30,781.07	140,527.00	5.31	2,506,645.00	94.69
互联 B 级	434	6,099.47	161.00	0.01	2,647,011.00	99.99
合计	9,188	18,128.67	281,773.79	0.17	166,284,413.73	99.83

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。

9.2 期末上市基金前十名持有人

互联 A 级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	丁碧霞	576,465.00	21.78
2	梁小红	253,937.00	9.59
3	庞剑锋	230,000.00	8.69
4	李怡名	207,762.00	7.85
5	高明桂	204,847.00	7.74
6	信达证券—兴业银行—信达证券睿丰3号集合资产管理计划	140,500.00	5.31
7	郑志坤	127,989.00	4.83
8	吕谷城	100,000.00	3.78
9	蒋时秀	82,780.00	3.13
10	蔡小婉	71,099.00	2.69

互联B级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	张文俊	134,265.00	5.07
2	邹光明	134,160.00	5.07
3	孙广煜	134,158.00	5.07
4	刘维清	127,048.00	4.80
5	黄启阶	125,546.00	4.74
6	赵向华	113,191.00	4.28
7	王安民	100,419.00	3.79
8	赵香	69,251.00	2.62
9	贡维贞	60,183.00	2.27
10	李正博	55,863.00	2.11

9.3 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	南方中证互联网指数分级	915.88	0.0006
	互联A级	-	-
	互联B级	-	-
	合计	915.88	0.0005

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）。

9.4 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

注：本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证互联网指数分级	互联 A 级	互联 B 级
基金合同生效日（2015 年 7 月 1 日）基金份额总额	611,872,014.42	-	-
本报告期期初基金份额总额	262,767,136.73	13,854,266.00	13,854,267.00
本报告期基金总申购份额	27,085,321.57	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	57,949,421.50	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-70,631,193.28	-11,207,094.00	-11,207,095.00
本报告期末基金份额总额	161,271,843.52	2,647,172.00	2,647,172.00

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及定期份额折算。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，基金管理人没有发生重大人事变动。

本报告期内，本行总行聘任刘琳同志、李智同志为本行托管业务部高级专家。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。本年度支付给普华永道中天

会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 54000 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 4 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	69,490,546.75	60.12%	6,949.79	60.13%	-
瑞银证券	1	46,086,899.40	39.88%	4,608.77	39.87%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
国泰君安	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。

11.7.2 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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	84,727.64	1.64%	-	-	-	-
瑞银证券	5,082,662.40	98.36%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。