

# 南方国策动力股票型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 3 月 27 日

## § 1 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。

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 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 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	南方国策动力股票
基金主代码	001692
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 26 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	150,204,981.82 份
基金合同存续期	不定期

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“南方国策动力”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	010-66105798

### 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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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

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	-39,787,845.85	595,786.55	15,724,837.82
本期利润	-32,653,081.97	6,864,550.42	-44,620,430.53
加权平均基金份额本期利润	-0.2136	0.0300	-0.1455
本期基金份额净值增长率	-20.58%	1.82%	-15.18%
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	-0.1547	0.0639	0.0454
期末基金资产净值	126,968,020.90	180,244,036.65	280,056,238.19
期末基金份额净值	0.845	1.064	1.045

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

3、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

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	-12.34%	1.68%	-9.65%	1.31%	-2.69%	0.37%
过去六个月	-17.48%	1.57%	-10.90%	1.20%	-6.58%	0.37%
过去一年	-20.58%	1.43%	-19.66%	1.07%	-0.92%	0.36%
过去三年	-31.41%	1.34%	-13.44%	0.94%	-17.97%	0.40%
自基金合同生效起至今	-13.44%	1.38%	3.12%	1.02%	-16.56%	0.36%

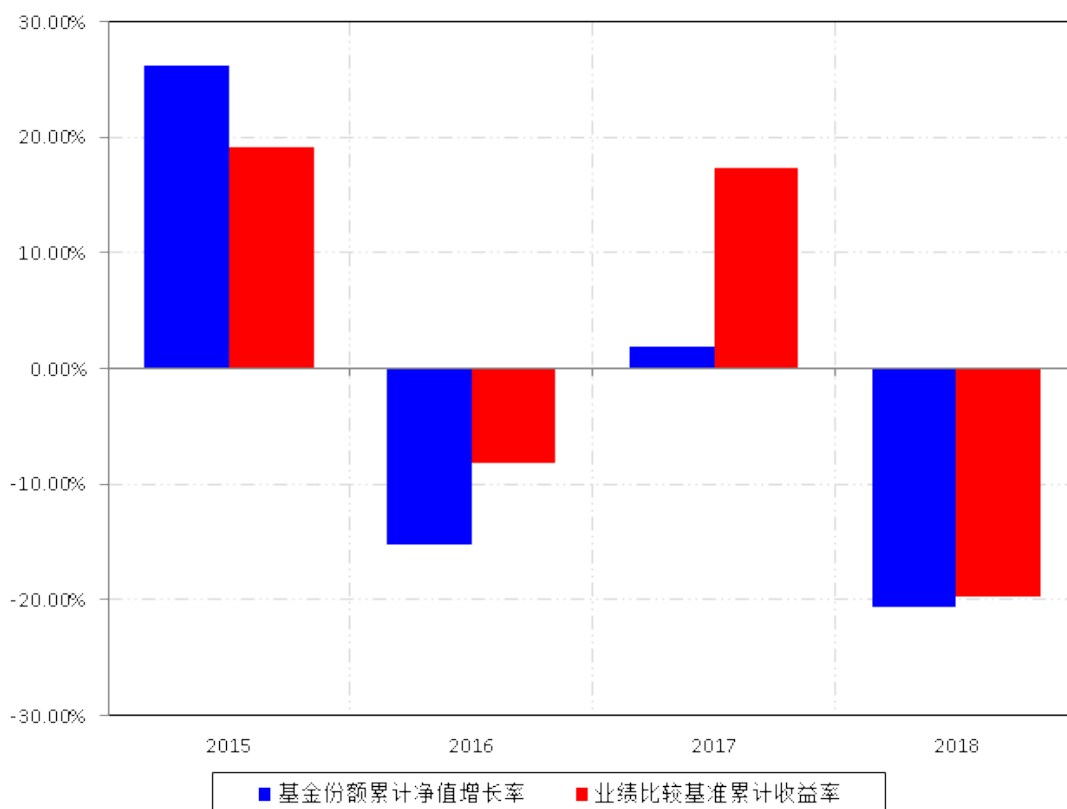
##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方国策动力股票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

南方国策动力股票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

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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		
罗安安	本基金基金经理	2018 年 6 月 8 日	-	8 年	清华大学计算机科学与技术专业博士，具有基金从业资格，2010 年 7 月加入南方基金，担任研究部高级研究员；2014 年 3 月至 2014 年 11 月，担任南方成长、南方价值基金经理助理；2014 年 11 月至 2015 年 7 月，担任投资经理；2015 年 7 月至今，任南方价值基金经理；2017 年 12 月至今，任南方新兴混合基金经理；2018 年 6 月至今，任南方国策动力基金经理；2018 年 10 月至今，任南方人工智能混合基金经理。
刘霄汉	本基金基金经理（已离任）	2015 年 8 月 26 日	2018 年 6 月 28 日	13 年	女，经济学硕士，具有基金从业资格。曾就职于中邮基金管理有限公司，历任研究员、研究组组长，2010 年 5 月至 2015 年 3 月担任中邮核心主题股票型基金基金经理。2015 年 4 月加入南方基金，曾任南方基金刘霄汉工作室负责人。2015 年 8 月至 2018 年 6 月，任南方国策动力基金经理；2015 年 11 月至 2018 年 6 月，任南方医保基金经理；



					2015 年 12 月至 2018 年 6 月，任南方沪港深价值、南方改革机遇基金经理； 2016 年 12 月至 2018 年 6 月，任南方睿见混合基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

## 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。

### 4.3.3 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

2018 年 A 股市场下跌幅度较大，上证综指下跌接近 25%，中证 500 下跌 33%。尽管我们在年初的投资策略中判断宏观经济不可能继续超预期，而且叠加金融监管趋严、银行表外理财资金收紧回表内等一些金融去杠杆政策，可能流动性是决定市场的主要因素，所以我们策略是“仓位保守，结构激进”，在年初的组合仓位一直是偏保守，结构偏向半导体、云计算等新兴板块。但是，超出我们预期的是中美贸易摩擦的影响，A 股在内外交困中持续下跌。三季度，虽然市场对于政府托底经济和股市的预期强烈，认为反弹即将开始，好在我们始终保持了冷静，认为经济下行压力带来的估值压力仍未充分反映，所以仓位控制在较低水平，从结构上更偏向与和宏观经济下行关联度不大的板块和行业，主要偏向医疗信息化、教育信息化、医疗服务等。当然，从结果上看，医疗板块受到医保局政策的影响调整比较大，而医疗信息化作为政府医保控费加强临床路径管理的手段而受益，起到了一定对冲作用。尽管市场的变化快速又剧烈，我们始终保持着紧密的宏观策略跟踪和坚持优质个股的投资方法，2018 年虽有波动，但可谓尽心尽力。

##### 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 0.845 元，报告期内，份额净值增长率为-20.58%，同期业绩基准增长率为-19.66%。

#### 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 2019 年，市场充分的下跌已经反映了经济下行的风险，预计政府会陆续出台一系列提振经济的政策，美国也进入到因宏观经济波动而放缓加息缩表的节奏，全球可能进入到逆周期操作的阶段。虽然中美贸易谈判的关键时点存在一定不确定性，但就目前时点来说，机会仍然大于风险。所以我们并不悲观，预计市场将始终处于反弹-震荡-再反复的过程，未来会寻找逆周期攻守兼具的板块或个股加大配置，同时积极研究个股，我们坚信选择符合未来国家产业趋势和优秀阿尔法标的，是在板块轮动和行业波动中把握市场未来机会的关键。

#### 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，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 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 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方国策动力股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，南方国策动力股票型证券投资基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方国策动力股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方国策动力股票型证券投资基金未有收益分配事项。

### 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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方国策动力股票型证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 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 23109 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：南方国策动力股票型证券投资基金

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		17,331,050.87	17,738,326.04
结算备付金		640,309.03	649,860.32
存出保证金		130,775.69	84,788.80
交易性金融资产		109,757,397.32	161,160,797.48
其中：股票投资		109,757,397.32	161,160,797.48
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	1,703,185.96
应收利息		4,243.25	3,914.25
应收股利		-	-
应收申购款		41,624.83	127,122.02
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		127,905,400.99	181,467,994.87
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		95,122.97	325,051.51

应付管理人报酬		166,197.16	234,033.51
应付托管费		27,699.54	39,005.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		294,223.16	271,205.19
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		354,137.26	354,662.41
负债合计		937,380.09	1,223,958.22
所有者权益：			
实收基金		150,204,981.82	169,420,903.33
未分配利润		-23,236,960.92	10,823,133.32
所有者权益合计		126,968,020.90	180,244,036.65
负债和所有者权益总计		127,905,400.99	181,467,994.87

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.845 元，基金份额总额 150,204,981.82 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方国策动力股票型证券投资基金

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		-27,496,867.84	12,985,962.91
1. 利息收入		205,933.78	233,302.55
其中：存款利息收入		164,036.09	223,221.84
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		41,897.69	10,080.71

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-34,892,885.61	6,278,306.87
其中：股票投资收益		-35,517,307.49	4,457,494.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		624,421.88	1,820,812.06
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		7,134,763.88	6,268,763.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		55,320.11	205,589.62
减：二、费用		5,156,214.13	6,121,412.49
1. 管理人报酬		2,258,159.27	3,688,009.75
2. 托管费		376,360.01	614,668.37
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		2,149,108.85	1,446,152.37
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用		372,586.00	372,582.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-32,653,081.97	6,864,550.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-32,653,081.97	6,864,550.42



## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方国策动力股票型证券投资基金

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	本期末 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)	169,420,903.33	10,823,133.32	180,244,036.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-32,653,081.97	-32,653,081.97
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)	-19,215,921.51	-1,407,012.27	-20,622,933.78
其中：1. 基金申购款	25,547,820.41	-568,567.16	24,979,253.25
2. 基金赎回款	-44,763,741.92	-838,445.11	-45,602,187.03
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)	150,204,981.82	-23,236,960.92	126,968,020.90
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)	267,904,475.33	12,151,762.86	280,056,238.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,864,550.42	6,864,550.42
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)	-98,483,572.00	-8,193,179.96	-106,676,751.96

填列)			
其中：1. 基金申购款	47,599,874.16	3,230,566.34	50,830,440.50
2. 基金赎回款	-146,083,446.16	-11,423,746.30	-157,507,192.46
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）	169,420,903.33	10,823,133.32	180,244,036.65

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 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

#### 7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

#### 7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.1.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 7.4.2 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。

### 7.4.3 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、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	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。

#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.4.1.1 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	544,725,583.44	38.24%	201,549,799.38	21.69%

###### 7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.4.1.3 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	496,405.76	38.24%	107,662.64	36.59%
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	183,673.30	21.62%	119,653.02	44.12%

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。

##### 7.4.4.2 关联方报酬

###### 7.4.4.2.1 基金管理费

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
当期发生的基金应支付的管理费	2,258,159.27	3,688,009.75

其中：支付销售机构的客户维护费	785,978.82	1,297,606.35
-----------------	------------	--------------

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 1.50% 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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

#### 7.4.4.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	376,360.01	614,668.37

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.4.4.2 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。

#### 7.4.4.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 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
工商银行	17,331,050.87	150,072.96	17,738,326.04	216,011.82

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

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

## 7.4.5 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

### 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### (1) 公允价值

#### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 109,757,397.32 元，无属于第二或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 153,562,148.19 元，第二层次 7,598,649.29 元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	109,757,397.32	85.81

	其中：股票	109,757,397.32	85.81
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	17,971,359.90	14.05
7	其他资产	176,643.77	0.14
8	合计	127,905,400.99	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	5,236,000.00	4.12
B	采矿业	-	-
C	制造业	50,068,147.50	39.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,880,804.00	5.42
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	35,442,866.92	27.91
J	金融业	3,927,000.00	3.09
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	78.90	0.00
R	文化、体育和娱乐业	8,202,500.00	6.46
S	综合	-	-
	合计	109,757,397.32	86.44

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。



## 8.3 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：

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	300559	佳发教育	241,279	8,312,061.55	6.55
2	300253	卫宁健康	561,800	7,000,028.00	5.51
3	600900	长江电力	433,300	6,880,804.00	5.42
4	000063	中兴通讯	350,000	6,856,500.00	5.40
5	300498	温氏股份	200,000	5,236,000.00	4.12
6	601098	中南传媒	400,000	5,000,000.00	3.94
7	300451	创业软件	257,627	4,933,557.05	3.89
8	002230	科大讯飞	200,000	4,928,000.00	3.88
9	600276	恒瑞医药	90,000	4,747,500.00	3.74
10	000338	潍柴动力	600,000	4,620,000.00	3.64

## 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	603986	兆易创新	20,541,109.55	11.40
2	600519	贵州茅台	17,860,721.66	9.91
3	600887	伊利股份	13,501,344.14	7.49
4	000423	东阿阿胶	12,956,548.63	7.19
5	300454	深信服	12,681,443.08	7.04
6	600900	长江电力	11,484,637.00	6.37
7	002376	新北洋	11,069,904.70	6.14
8	002410	广联达	10,590,460.24	5.88
9	002008	大族激光	10,433,147.49	5.79
10	000661	长春高新	10,104,643.00	5.61
11	601318	中国平安	10,081,780.96	5.59
12	600276	恒瑞医药	9,686,498.27	5.37
13	000651	格力电器	9,655,992.00	5.36
14	603019	中科曙光	9,546,533.63	5.30
15	300559	佳发教育	9,521,451.96	5.28
16	002027	分众传媒	9,384,778.40	5.21
17	601166	兴业银行	9,381,437.76	5.20
18	300059	东方财富	9,286,429.60	5.15
19	300750	宁德时代	8,887,544.74	4.93
20	300253	卫宁健康	8,808,475.66	4.89
21	300413	芒果超媒	8,642,706.00	4.80

22	300496	中科创达	8,529,564.18	4.73
23	601888	中国国旅	8,193,589.80	4.55
24	300144	宋城演艺	7,924,035.00	4.40
25	002415	海康威视	7,705,319.65	4.27
26	300451	创业软件	7,575,589.00	4.20
27	300498	温氏股份	7,284,713.15	4.04
28	600486	扬农化工	7,086,977.33	3.93
29	002127	南极电商	7,049,109.76	3.91
30	300373	扬杰科技	7,043,316.00	3.91
31	000002	万 科 A	6,998,037.00	3.88
32	600038	中直股份	6,996,303.53	3.88
33	000063	中兴通讯	6,864,839.00	3.81
34	000538	云南白药	6,777,311.75	3.76
35	600673	东阳光科	6,679,464.55	3.71
36	300122	智飞生物	6,409,441.85	3.56
37	002230	科大讯飞	6,343,481.00	3.52
38	300474	景 嘉 微	6,281,846.20	3.49
39	600138	中 青 旅	6,256,285.25	3.47
40	000338	潍柴动力	6,226,270.00	3.45
41	300571	平治信息	6,226,139.50	3.45
42	002422	科伦药业	6,119,751.26	3.40
43	002179	中航光电	6,007,740.35	3.33
44	300003	乐普医疗	5,854,685.00	3.25
45	300568	星源材质	5,830,101.13	3.23
46	600009	上海机场	5,616,213.42	3.12
47	600028	中国石化	5,409,000.00	3.00
48	002507	涪陵榨菜	5,328,826.55	2.96
49	000830	鲁西化工	5,325,195.00	2.95
50	002624	完美世界	5,299,336.00	2.94
51	600027	华电国际	5,193,627.22	2.88
52	300577	开润股份	5,129,585.62	2.85
53	600760	中航沈飞	5,049,305.00	2.80
54	002841	视源股份	4,833,680.80	2.68
55	601098	中南传媒	4,628,190.00	2.57
56	002236	大华股份	4,490,885.10	2.49
57	002419	天虹股份	4,478,904.84	2.48
58	000066	中国长城	4,471,439.31	2.48
59	300601	康泰生物	4,428,563.02	2.46
60	300036	超图软件	4,351,380.80	2.41
61	300251	光线传媒	4,348,005.00	2.41
62	002352	顺丰控股	4,220,913.00	2.34
63	601668	中国建筑	4,166,000.00	2.31
64	300628	亿联网络	4,097,312.00	2.27

65	603508	思维列控	4,091,543.00	2.27
66	600036	招商银行	4,064,184.00	2.25
67	002384	东山精密	4,055,622.00	2.25
68	600674	川投能源	4,055,160.00	2.25
69	002372	伟星新材	4,038,066.04	2.24
70	603039	泛微网络	3,943,863.92	2.19
71	600690	青岛海尔	3,900,326.00	2.16
72	000597	东北制药	3,872,400.45	2.15
73	300684	中石科技	3,790,353.06	2.10
74	601857	中国石油	3,614,604.00	2.01

注：1. 买入包括基金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；

2. 基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”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。

#### 8.4.2 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	19,803,261.00	10.99
2	603986	兆易创新	17,108,410.60	9.49
3	600036	招商银行	16,824,077.38	9.33
4	600519	贵州茅台	16,129,656.68	8.95
5	000423	东阿阿胶	12,795,359.12	7.10
6	300454	深信服	12,717,476.00	7.06
7	603019	中科曙光	11,953,758.00	6.63
8	002624	完美世界	11,014,860.00	6.11
9	002008	大族激光	10,831,525.99	6.01
10	002410	广联达	10,714,880.51	5.94
11	000963	华东医药	9,729,842.50	5.40
12	000651	格力电器	9,409,441.54	5.22
13	300750	宁德时代	9,343,957.35	5.18
14	002027	分众传媒	9,188,007.36	5.10
15	300059	东方财富	9,051,435.49	5.02
16	600887	伊利股份	9,027,809.98	5.01
17	300413	芒果超媒	8,937,929.50	4.96
18	300424	航新科技	8,865,718.59	4.92
19	000661	长春高新	8,491,649.00	4.71
20	300496	中科创达	8,428,375.09	4.68
21	000538	云南白药	8,309,186.54	4.61
22	002462	嘉事堂	8,259,263.60	4.58
23	601888	中国国旅	8,205,545.89	4.55

24	000028	国药一致	8,140,962.75	4.52
25	002519	银河电子	7,841,124.22	4.35
26	002517	恺英网络	7,778,548.88	4.32
27	300203	聚光科技	7,543,623.00	4.19
28	000002	万科A	7,280,242.00	4.04
29	300373	扬杰科技	7,117,417.00	3.95
30	600038	中直股份	7,029,552.63	3.90
31	600118	中国卫星	6,866,371.53	3.81
32	002415	海康威视	6,743,145.40	3.74
33	002376	新北洋	6,603,711.47	3.66
34	600673	东阳光科	6,584,536.87	3.65
35	600745	闻泰科技	6,447,212.00	3.58
36	600138	中青旅	6,292,939.00	3.49
37	000830	鲁西化工	6,100,424.00	3.38
38	002179	中航光电	5,996,393.82	3.33
39	600151	航天机电	5,963,509.89	3.31
40	600760	中航沈飞	5,771,746.33	3.20
41	300628	亿联网络	5,758,326.00	3.19
42	601336	新华保险	5,742,262.20	3.19
43	002422	科伦药业	5,683,759.00	3.15
44	600486	扬农化工	5,657,624.14	3.14
45	600562	国睿科技	5,542,906.80	3.08
46	600027	华电国际	5,374,380.00	2.98
47	002127	南极电商	5,372,885.60	2.98
48	600009	上海机场	5,246,346.92	2.91
49	300144	宋城演艺	5,219,802.10	2.90
50	000513	丽珠集团	5,174,311.00	2.87
51	600703	三安光电	5,165,434.00	2.87
52	300036	超图软件	5,158,988.89	2.86
53	300122	智飞生物	5,133,454.86	2.85
54	600028	中国石化	5,102,000.00	2.83
55	002672	东江环保	5,060,215.00	2.81
56	601318	中国平安	4,906,522.00	2.72
57	300571	平治信息	4,863,770.00	2.70
58	300451	创业软件	4,724,327.26	2.62
59	600563	法拉电子	4,622,368.00	2.56
60	300003	乐普医疗	4,545,753.60	2.52
61	600030	中信证券	4,488,311.04	2.49
62	300251	光线传媒	4,318,240.56	2.40
63	603039	泛微网络	4,299,454.95	2.39
64	300568	星源材质	4,266,038.00	2.37
65	300684	中石科技	4,221,733.98	2.34
66	600584	长电科技	4,220,083.00	2.34

67	002507	涪陵榨菜	4,126,688.00	2.29
68	600900	长江电力	4,102,110.00	2.28
69	600674	川投能源	4,008,513.00	2.22
70	300760	迈瑞医疗	3,881,067.00	2.15
71	002419	天虹股份	3,863,174.67	2.14
72	300601	康泰生物	3,838,260.50	2.13
73	600690	青岛海尔	3,803,327.77	2.11
74	601857	中国石油	3,789,348.00	2.10
75	002352	顺丰控股	3,742,251.74	2.08
76	600011	华能国际	3,728,954.48	2.07
77	002916	深南电路	3,694,843.36	2.05
78	601668	中国建筑	3,639,144.00	2.02
79	002384	东山精密	3,632,782.51	2.02

注：1、卖出主要指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；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”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。

#### 8.4.3 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	701,413,996.57
卖出股票收入（成交）总额	724,434,853.12

注：1、买入包括基金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，卖出主要指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；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 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

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

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

无。

### 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。基金管理人将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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2

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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 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（元）
1	存出保证金	130,775.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,243.25
5	应收申购款	41,624.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	176,643.77

### 8.12.4 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债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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

持有	户均持有的基金份	持有人结构
----	----------	-------

人户数 (户)	额	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
9,818	15,298.94	3,550,630.55	2.36%	146,654,351.27	97.64%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	53,083.80	0.0353%

## 9.3 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

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

基金合同生效日(2015年8月26日)基金份额总额	465,402,845.82
本报告期期初基金份额总额	169,420,903.33



本报告期基金总申购份额	25,547,820.41
减：报告期基金总赎回份额	44,763,741.92
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	150,204,981.82

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

## 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，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 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，无涉及基金管理人的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务 4 年，本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 54,000.00 元。

## 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，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金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	2	544,725,583.44	38.24%	496,405.76	38.24%	-
中信证券	1	374,309,888.93	26.27%	341,110.24	26.27%	-
中金公司	1	186,886,497.96	13.12%	170,309.95	13.12%	-
国信证券	1	185,203,278.40	13.00%	168,774.19	13.00%	-
银河证券	1	102,037,875.10	7.16%	92,987.73	7.16%	-
招商证券	1	31,486,851.66	2.21%	28,693.25	2.21%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	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
华泰证券	-	-	320,000,000.00	75.65%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	103,000,000.00	24.35%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

