

南方甄智定期开放混合型发起式证券投资基金 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：招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。

基金托管人招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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方甌智定期开放混合型发起式
基金主代码	002850
交易代码	002850
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 7 月 6 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	181,007,168.93 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“南方甌智”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。
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，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，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×20%+中债综合指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	张燕
	联系电话	0755-82763888	0755-83199084
	电子邮箱	manager@southernfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95555
传真		0755-82763889	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦

	厦 32-42 楼	
邮政编码	518017	518040
法定代表人	张海波	李建红

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

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年 7 月 6 日- 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-4,323,694.49	-102,055,409.73	316,834.89
本期利润	-675,753.87	-69,874,898.93	-36,507,750.98
加权平均基金份额本期利润	-0.0010	-0.0600	-0.0313
本期基金份额净值增长率	-1.76%	-6.19%	-3.10%
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	-0.1072	-0.0913	-0.0313
期末基金资产净值	161,607,920.48	1,058,222,961.01	1,128,097,859.94
期末基金份额净值	0.893	0.909	0.969

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	-2.40%	0.36%	-0.95%	0.32%	-1.45%	0.04%
过去六个月	-1.65%	0.29%	-0.83%	0.29%	-0.82%	0.00%

过去一年	-1.76%	0.31%	-1.73%	0.26%	-0.03%	0.05%
自基金合同生效起至今	-10.70%	0.31%	-1.03%	0.21%	-9.67%	0.10%

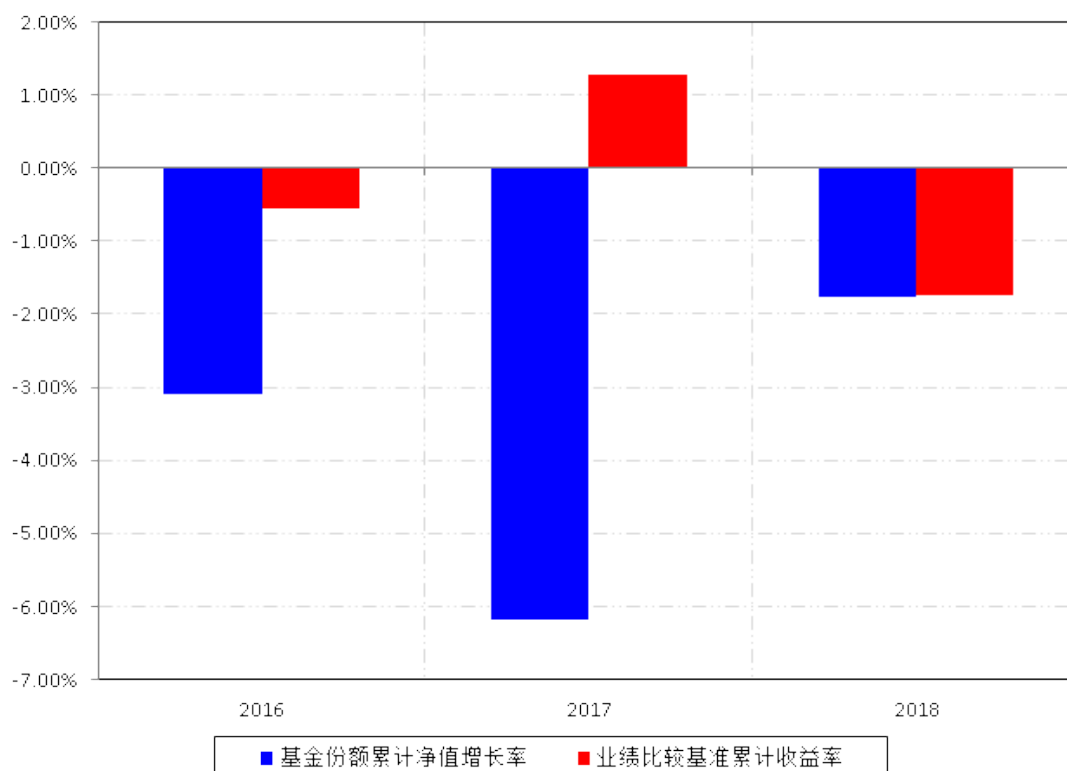
3.2.2 自基金合同生效/自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方甄智定期开放混合型发起式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

南方甌智定期开放混合型发起式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

本基金于 2016 年 7 月 6 日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

§ 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		
刘文良	本基金基金经理	2016 年 7 月 6 日	-	6 年	北京大学金融学专业硕士，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入南方基金，历任固定收益部转债研究员、宏观研究员、信用分析师；2015 年 2 月至 2015 年 8 月，任南方永利基金经理助理；2015 年 12 月至 2017 年 2 月，任南方弘利基金经理；2015 年 12 月至 2017 年 5 月，任南方安心基金经理；2016 年 11 月至 2018 年 2 月，任南方荣发基金经理；2016 年 11 月至 2018 年 2 月，任南方卓元基金经理；2017 年 5 月至 2018 年 7 月，任南方和利、南方和元、南方纯元基金经理；2017 年 6 月至 2018 年 7 月，任南方高元基金经理；2015 年 8 月至今，任南方永利基金经理；2016 年 6 月至今，任南方广利基金经理；2016 年 7 月至今，任南方甌智混合基金经理；2017 年 8 月至今，任南方祥元基金经理；2017 年 9 月至今，任南方兴利基金经理；2018 年 3 月至今，任南方希元转债基金经理。
林乐峰	本基金基金经理	2017 年 12 月 15 日	-	10 年	北京大学理学硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金研究部，历任研究员、高级研究员，负责钢铁、机械制造、中小市值的行业研究。2015 年 2 月至 2016 年 3 月，任南方高增长基金经理助理；2016 年 3 月至今，任南方宝元基金经理；2017 年 8 月至今，任南方安康混合基金经理；2017 年 12 月至今，任南方甌智混合、南方转型混合基金经理。
孙鲁闽	本基金基金经理	2018 年 6 月 15 日	-	15 年	南开大学理学和经济学双学士、澳大利亚新南威尔士大学商学硕士，具有基金从业资格。曾任职于厦门国际银行福州分行，2003 年 4 月加入南方基金，历任

					行业研究员、南方高增和南方隆元的基金经理助理、专户投资管理部总监助理、权益投资部副总监，现任权益投资部董事总经理；2007 年 12 月至 2010 年 10 月，担任南方基金企业年金和专户的投资经理。2011 年 6 月至 2017 年 7 月，任南方保本基金经理；2015 年 12 月至 2017 年 12 月，任南方瑞利保本基金经理；2015 年 5 月至 2018 年 6 月，任南方丰合保本基金经理；2010 年 12 月至今，任南方避险基金经理；2015 年 4 月至今，任南方利淘基金经理；2015 年 5 月至今，任南方利鑫基金经理；2016 年 1 月至今，任南方益和保本基金经理；2016 年 9 月至今，任南方安泰混合基金经理；2016 年 11 月至今，任南方安裕混合基金经理；2017 年 7 月至今，任南方安睿混合基金经理；2017 年 12 月至今，任南方瑞利混合基金经理；2018 年 1 月至今，任南方融尚再融资基金经理；2018 年 6 月至今，任南方新蓝筹混合、南方改革机遇、南方甌智混合基金经理；2018 年 11 月至今，任南方固胜定期开放混合基金经理。
--	--	--	--	--	--

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，两组组合间单日、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，中国经济增长呈现回落的态势，全年 GDP 增长 6.6%。分季度来看，放缓的迹象更为明显，四个季度的同比增长依次是 6.8%、6.7%、6.5%、6.4%。与此同时，PMI 数据也持续下行，在 12 月跌至 49.4，这也是近三年来首次跌破荣枯线。固定资产投资和消费增速都继续下滑，很多行业的景气度从三四季度开始显著下行。这一方面是由于中国经济的正常周期波动导致，另一方面上半年开始引发的中美贸易摩擦也对进出口相关产业带来了负面影响。G20 会议期间的会谈一度使得中美贸易摩擦略微有所缓和，但华为事件的发酵预示着中美关系的未来依然存在很大的不确定性。不过美国经济数据开始有放缓迹象、美联储加息态度转向鸽派、美股出现调整，这些现象也一定程度上会影响到美国对华态度。国内方面，货币政策从年中开始转向，政策底部确认，央行连续降准，而市场底仍在探寻中，年底全部 A 股的整体市盈率创下近年来新低，已经适合长期投资者布局。A 股市场在 2018 年全面下跌，上证指数下跌 24.59%。不同风格来看，沪深 300 指数下跌 25.31%，中小板指下跌 37.75%，创业板指下跌 28.65%。各行业指数全部下跌，跌幅最小的餐饮旅游、

银行、石油石化行业指数分别下跌 8.69%、10.95%、18.76%，跌幅最大的电子元器件行业指数下跌 41.31%。

权益投资方面，我们认为国内经济具备韧性，政策重回放松有利于宏观经济的托底，减税等举措对未来消费的提振也有积极作用，目前来看经济增速在下滑阶段出现断崖风险的可能性小。市场层面，从政策底到市场底到业绩底存在一定的时滞，短期市场可能继续震荡筑底，宜从中长期角度做布局。上市公司层面，一些优秀的公司业绩仍处于较理想的增速，继续从长期可持续性的角度配置消费品，尤其是部分必需消费品优质个股的配置，对于强周期板块和贸易摩擦相关板块仍保持回避。另一方面，由于债券收益率的下行，高股息股票的相对回报吸引力显著上升，我们也进行了一定的配置。此外，部分优质成长股随着市场回调到合理位置时，我们也会择机配置。

安全资产方面，去杠杆带来的信用收缩导致 2018 年经济基本面转弱，货币政策转向宽松，银行间流动性充裕，但 7 月以来的宽信用政策传导不畅，社融增速持续下行，中美贸易战加剧使得市场风险偏好大幅降低，全年利率曲线陡峭化下行，1 年国债、1 年国开收益率分别下行 119BP、193BP，10 年国债、10 年国开收益率分别下行 65BP、118BP，利率债和高等级信用债表现好于中低评级信用债。2018 年南方甌智债券部分主要采取期限匹配策略，配置以中短期信用债为主，获取票息收益，二季度提前减仓为开放期准备流动性，四季度提高了信用债的配置比例，适当利用杠杆提高组合静态收益。

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 0.893 元，报告期内，份额净值增长率为-1.76%，同期业绩基准增长率为-1.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年经济增长下行压力较大，美联储加息周期末期，海外和汇率因素对央行的制约降低，国内货币政策进一步宽松，保持流动性合理充裕的同时，重点疏通利率传导机制，由宽货币、紧信用向宽货币、宽信用过渡，2018 年以利率债和 AAA 信用债为代表的避险资产表现较好，未来半年利率仍处于下行趋势当中，但收益空间显著小于 2018 年，目前龙头房地产和民企、城投债的信用利差仍较高，预计在宽信用逐步落地的过程中有信用利差收敛的行情。南方甌智债券部分将坚持获取票息为主的原则，在做好信用风险控制的前提下，重点配置利差较高的信用债，积极利用杠杆，提高组合静态收益水平，同时做好组合的流动性管理。

对于权益市场，2018 年的大幅下跌已经一定程度上释放了经济增速下滑的风险。当前 A 股的估值已经处于近年来的底部区域，对于长期投资者来说，已经是适合建仓的位置。

中短期来看，仍需提防一些强周期行业以及出口相关行业的下行风险，应选择景气度上行或者不受经济周期影响的行业，精选质地优秀、能够穿越周期的上市公司。

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；每一基金份额享有同等分配权；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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

不适用。

§ 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度/年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度/年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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 23169 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：南方甌智定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	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	1,665,063.80	1,973,599.76
结算备付金	5,185,297.76	17,661,543.02
存出保证金	113,066.26	192,822.58

交易性金融资产	241,944,132.54	1,504,387,134.33
其中：股票投资	31,967,637.24	283,076,335.13
基金投资	—	—
债券投资	209,976,495.30	1,221,310,799.20
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	2,000,000.00	—
应收利息	4,681,037.49	20,798,954.79
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	255,588,597.85	1,545,014,054.48
负债和所有者权益	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	90,958,778.91	483,317,640.02
应付证券清算款	2,324,041.89	207,910.12
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	206,689.44	1,347,501.10
应付托管费	34,448.26	224,583.52
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	60,927.53	808,024.09
应交税费	22,480.95	—
应付利息	3,310.39	494,434.62
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	370,000.00	391,000.00

负债合计	93,980,677.37	486,791,093.47
所有者权益：		
实收基金	181,007,168.93	1,164,605,610.92
未分配利润	-19,399,248.45	-106,382,649.91
所有者权益合计	161,607,920.48	1,058,222,961.01
负债和所有者权益总计	255,588,597.85	1,545,014,054.48

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.893 元，基金份额总额 181,007,168.93 份。

7.2 利润表

会计主体：南方甌智定期开放混合型发起式证券投资基金

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	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	18,376,170.75	-30,021,872.34
1. 利息收入	35,181,947.04	47,704,312.63
其中：存款利息收入	164,592.97	415,444.74
债券利息收入	31,942,036.39	47,165,708.72
资产支持证券利息收入	2,122,406.57	-
买入返售金融资产收入	952,911.11	123,159.17
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-20,453,794.59	-109,906,695.77
其中：股票投资收益	-15,095,182.94	-104,792,219.89
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-5,817,388.20	-7,448,797.82
资产支持证券投资收益	-1,180,026.04	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,638,802.59	2,334,321.94
3. 公允价值变动收益（损失以	3,647,940.62	32,180,510.80

“-”号填列)		
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	77.68	-
减：二、费用	19,051,924.62	39,853,026.59
1. 管理人报酬	9,671,392.44	16,572,903.31
2. 托管费	1,611,898.68	2,762,150.60
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,220,569.06	3,851,461.45
5. 利息支出	5,999,251.26	16,217,438.32
其中：卖出回购金融资产支出	5,999,251.26	16,217,438.32
6. 税金及附加	119,881.31	-
7. 其他费用	428,931.87	449,072.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-675,753.87	-69,874,898.93
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-675,753.87	-69,874,898.93

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方甌智定期开放混合型发起式证券投资基金

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）	1,164,605,610.92	-106,382,649.91	1,058,222,961.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-675,753.87	-675,753.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-983,598,441.99	87,659,155.33	-895,939,286.66

(净值减少以“—”号填列)			
其中：1. 基金申购款	738,866.85	-62,272.00	676,594.85
2. 基金赎回款	-984,337,308.84	87,721,427.33	-896,615,881.51
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）	181,007,168.93	-19,399,248.45	161,607,920.48
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）	1,164,605,610.92	-36,507,750.98	1,128,097,859.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-69,874,898.93	-69,874,898.93
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）	1,164,605,610.92	-106,382,649.91	1,058,222,961.01

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 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。

7.4.1.3 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。

7.4.2 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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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	59,044,038.11	8.09%	1,290,407,144.63	50.05%

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	53,017.95	8.00%	21,399.99	36.21%
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	1,181,150.22	50.13%	355,443.53	45.42%

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	9,671,392.44	16,572,903.31
其中：支付销售机构的客户维护费	4,593,499.16	8,048,600.79

注：支付基金管理人南方基金管理股份有限公司的基金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：

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

7.4.4.2.2 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	1,611,898.68	2,762,150.60

注：支付基金托管人招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：

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

7.4.4.2.3 销售服务费

无。

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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2016 年 07 月 06 日）持有的基金份 额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,007,389.62	10,007,389.62
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总 份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,007,389.62	10,007,389.62
报告期末持有的基金份额占 基金总份额比例	5.53%	0.86%

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
招商银行	1,665,063.80	46,176.15	1,973,599.76	66,016.30

注：本基金的银行存款由基金托管人招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。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

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

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
600270	外运发展	2018 年 12 月 13 日	重大资产重组	20.99	-	-	140,000	2,942,754.45	2,938,600.00	-

注：1. 根据中外运空运发展股份有限公司（以下简称“外运发展”）于 2018 年 11 月 3 日公布的《中国外运股份有限公司换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司暨关联交易报告书》和中国外运股份有限公司（以下简称“中国外运”）于 2019 年 1 月 15 日公布的《中国外运发行 A 股股份换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司上市公告书暨 2018 年第三季度财务报表》，中国外运向外运发展除中国外运以外的股东发行 A 股股票，以换股比例 1:3.8225 取得外运发展股东持有的外运发展全部股票，吸收合并外运发展；外运发展自 2018 年 12 月 13 日起连续停牌。换股合并后新增的中国外运股票于 2019 年 1 月 18 日上市流通，当日开盘单价为 5.30 元。外运发展自 2018 年 12 月 28 日起终止上市并摘牌。

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**

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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 14,058,778.91 元，是以如下债券作为抵押：

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
011801511	18 日照港 SCP004	2019 年 1 月 7 日	100.68	100,000	10,068,000.00
011801799	18 南山集 SCP007	2019 年 1 月 7 日	100.13	41,000	4,105,330.00
合计	-	-	-	141,000	14,173,330.00

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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 76,900,000.00 元，截至 2019 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金

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。

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 29,029,037.24 元，属于第二层次的余额为 212,915,095.30 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 279,362,003.38 元，第二层次 1,225,025,130.95 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	31,967,637.24	12.51
	其中：股票	31,967,637.24	12.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	209,976,495.30	82.15
	其中：债券	209,976,495.30	82.15
	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	6,850,361.56	2.68
8	其他资产	6,794,103.75	2.66
9	合计	255,588,597.85	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	23,450,237.24	14.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,588,000.00	0.98
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,790,000.00	1.73
G	交通运输、仓储和邮政业	2,938,600.00	1.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,200,800.00	0.74
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	31,967,637.24	19.78

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	000895	双汇发展	150,000	3,538,500.00	2.19
2	600270	外运发展	140,000	2,938,600.00	1.82
3	600511	国药股份	120,000	2,790,000.00	1.73
4	600887	伊利股份	100,000	2,288,000.00	1.42
5	600741	华域汽车	120,080	2,209,472.00	1.37
6	002661	克明面业	150,000	1,851,000.00	1.15
7	300470	日机密封	80,000	1,780,000.00	1.10
8	600900	长江电力	100,000	1,588,000.00	0.98
9	002701	奥瑞金	300,000	1,518,000.00	0.94
10	002117	东港股份	100,000	1,415,000.00	0.88

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。

8.4 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	600519	贵州茅台	12,981,512.00	1.23
2	601939	建设银行	10,515,938.00	0.99
3	000063	中兴通讯	10,035,319.00	0.95
4	300470	日机密封	10,004,642.60	0.95
5	601318	中国平安	9,913,885.00	0.94
6	600030	中信证券	9,564,257.00	0.90
7	000651	格力电器	8,526,047.67	0.81
8	600056	中国医药	7,787,812.86	0.74
9	300408	三环集团	7,494,632.90	0.71
10	601888	中国国旅	6,338,454.15	0.60
11	601808	中海油服	5,700,037.44	0.54

12	002027	分众传媒	5,113,135.00	0.48
13	600809	山西汾酒	5,064,866.77	0.48
14	601818	光大银行	5,027,626.00	0.48
15	300327	中颖电子	5,022,638.85	0.47
16	601966	玲珑轮胎	5,011,187.13	0.47
17	002353	杰瑞股份	4,862,110.85	0.46
18	600486	扬农化工	4,664,314.00	0.44
19	600282	南钢股份	4,462,639.00	0.42
20	000089	深圳机场	4,329,939.00	0.41

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	600872	中炬高新	18,822,010.33	1.78
2	600999	招商证券	18,109,833.24	1.71
3	600486	扬农化工	15,756,686.60	1.49
4	600887	伊利股份	14,561,149.35	1.38
5	000786	北新建材	14,416,919.00	1.36
6	000910	大亚圣象	13,891,086.23	1.31
7	601169	北京银行	13,654,517.82	1.29
8	002714	牧原股份	13,454,780.41	1.27
9	600519	贵州茅台	12,689,506.62	1.20
10	002511	中顺洁柔	11,709,374.93	1.11
11	300271	华宇软件	11,575,595.46	1.09
12	000001	平安银行	11,336,316.17	1.07
13	601166	兴业银行	11,266,996.00	1.06
14	300367	东方网力	10,919,240.72	1.03
15	002279	久其软件	10,137,342.82	0.96
16	601009	南京银行	10,132,294.29	0.96
17	603228	景旺电子	10,016,847.18	0.95
18	601318	中国平安	9,864,603.30	0.93
19	601601	中国太保	9,422,814.25	0.89
20	601939	建设银行	9,313,005.00	0.88

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	250,456,560.79
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	480,871,711.18
--------------	----------------

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	129,405,495.30	80.07
5	企业短期融资券	70,375,000.00	43.55
6	中期票据	10,196,000.00	6.31
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	209,976,495.30	129.93

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	136390	16 人福债	150,000	14,935,500.00	9.24
2	101456016	14 凉山国投 MTN001	100,000	10,196,000.00	6.31
3	011801308	18 天士力 SCP001	100,000	10,088,000.00	6.24
4	041800123	18 碧水源 CP001	100,000	10,080,000.00	6.24
5	011801511	18 日照港 SCP004	100,000	10,068,000.00	6.23

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

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

无。

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

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 声明本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内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券除 18 新城控股 SCP002（证券代码 011801852）外其他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。

2018 年 1 月 19 日，江苏证监局对公司出具了警示函，原因系公司及合并报表范围内子公司连续 12 个月累计诉讼金额达到 12.34 亿元，超过 1000 万元，且占公司 2015 年经审计净资产绝对值 10%以上，但公司未依据《上海证券交易所股票上市规则》及时予以披露。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

8.12.2 声明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。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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	113,066.26
2	应收证券清算款	2,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	4,681,037.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,794,103.75

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处于转股期的可转换债券。

8.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600270	外运发展	2,938,600.00	1.82	重大事项

§ 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
1,682	107,614.25	10,007,389.62	5.53%	170,999,779.31	94.47%

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	50,416.79	0.0279%

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

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,007,389.62	5.53	9,900,000.00	5.47	自合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	105,767.53	0.06	100,000.00	0.06	自合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,113,157.15	5.59	10,000,000.00	5.52	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016 年 7 月 06 日)基金份额总额	1,164,605,610.92
本报告期期初基金份额总额	1,164,605,610.92
本报告期基金总申购份额	738,866.85
减：报告期基金总赎回份额	984,337,308.84
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	181,007,168.93

§ 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管理人、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 3 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 70,000.00 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	
银河证券	1	199,021,090.05	27.28%	181,136.39	27.33%	-
西藏东财	1	189,455,412.85	25.97%	172,645.92	26.05%	-
广发证券	1	184,583,718.46	25.30%	167,439.17	25.27%	-
方正证券	1	97,455,241.00	13.36%	88,485.80	13.35%	-
华泰证券	2	59,044,038.11	8.09%	53,017.95	8.00%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

财通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	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。

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
银河证券	227,739,375.00	27.56%	6,444,800,000.00	42.71%	-	-
西藏东财	227,134,839.10	27.49%	6,610,300,000.00	43.81%	-	-
广发证券	38,594,771.80	4.67%	1,000,000.00	0.01%	-	-
方正证券	15,974,906.70	1.93%	25,841,000.00	0.17%	-	-
华泰证券	316,793,214.25	38.34%	2,008,040,000.00	13.31%	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

§ 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。