

# 南方荣知定期开放混合型证券投资基金 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 重要提示及目录

### 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	南方荣知定期开放混合	
基金主代码	004443	
交易代码	004443	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 6 月 15 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	45,067,081.62 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方荣知定期开放混合 A	南方荣知定期开放混合 C
下属分级基金的交易代码	004443	004444
报告期末下属分级基金的份 额总额	16,706,872.50 份	28,360,209.12 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“南方荣知”。

### 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及投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。
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，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×15%+中债综合指数收益率×85%
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	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

##### 1、南方荣知定期开放混合 A

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年 6 月 15 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	954,742.51	2,157,168.39
本期利润	1,709,172.48	1,742,474.42
加权平均基金份额本期利润	0.0358	0.0206
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0493	0.0206
期末基金资产净值	18,061,435.70	86,239,959.80
期末基金份额净值	1.0811	1.0206
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	8.11%	2.06%

##### 2、南方荣知定期开放混合 C

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年 6 月 15 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,661,304.39	5,508,579.13
本期利润	3,083,902.90	4,292,912.70
加权平均基金份额本期利润	0.0239	0.0173
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0395	0.0173
期末基金资产净值	30,375,328.37	252,600,489.07
期末基金份额净值	1.0711	1.0173
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	7.11%	1.73%

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

南方荣知定期开放混合 A

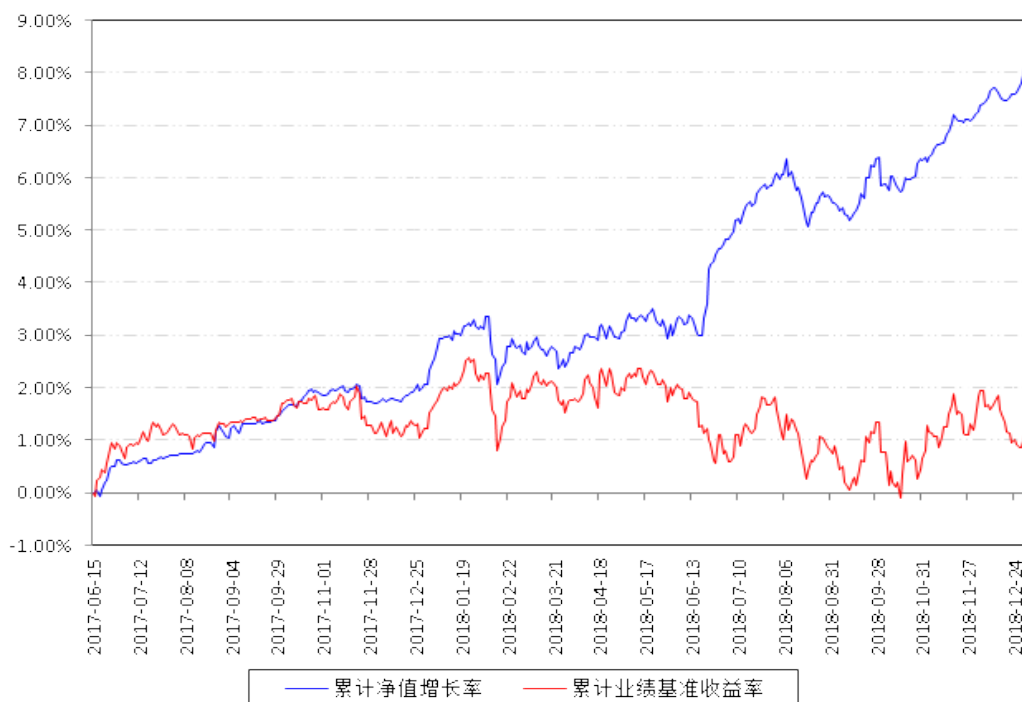
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	1.63%	0.11%	-0.22%	0.24%	1.85%	-0.13%
过去六个月	3.33%	0.12%	0.01%	0.22%	3.32%	-0.10%
过去一年	5.93%	0.13%	-0.13%	0.20%	6.06%	-0.07%
自基金合同 生效起至今	8.11%	0.11%	1.11%	0.17%	7.00%	-0.06%

南方荣知定期开放混合 C

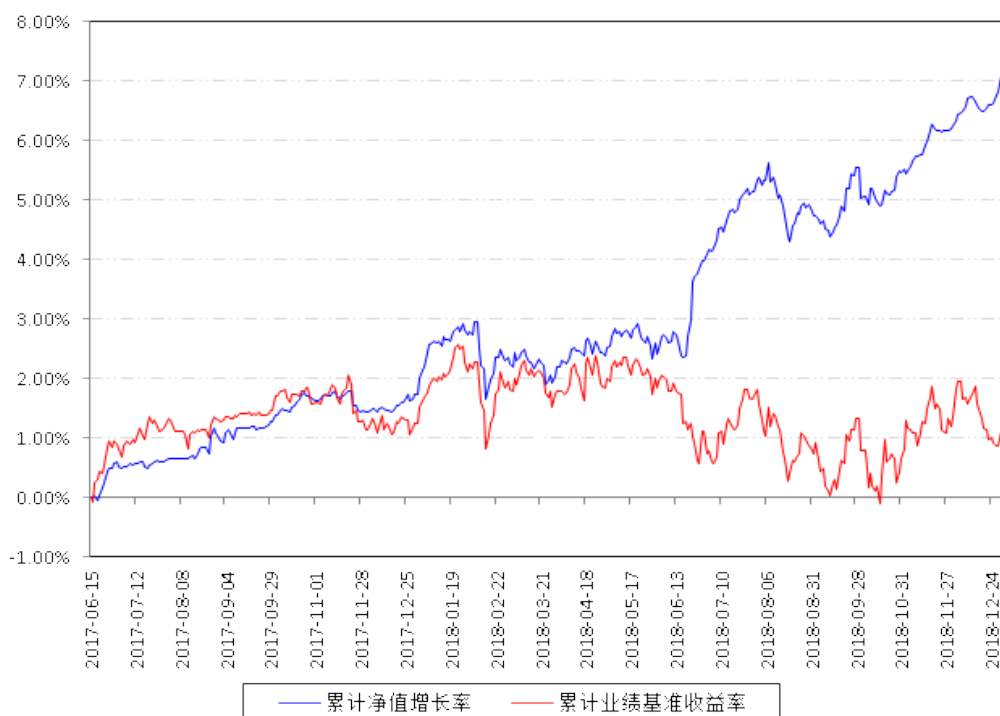
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	1.48%	0.11%	-0.22%	0.24%	1.70%	-0.13%
过去六个月	3.02%	0.12%	0.01%	0.22%	3.01%	-0.10%
过去一年	5.29%	0.13%	-0.13%	0.20%	5.42%	-0.07%
自基金合同 生效起至今	7.11%	0.11%	1.11%	0.17%	6.00%	-0.06%

#### 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

南方荣知定期开放混合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

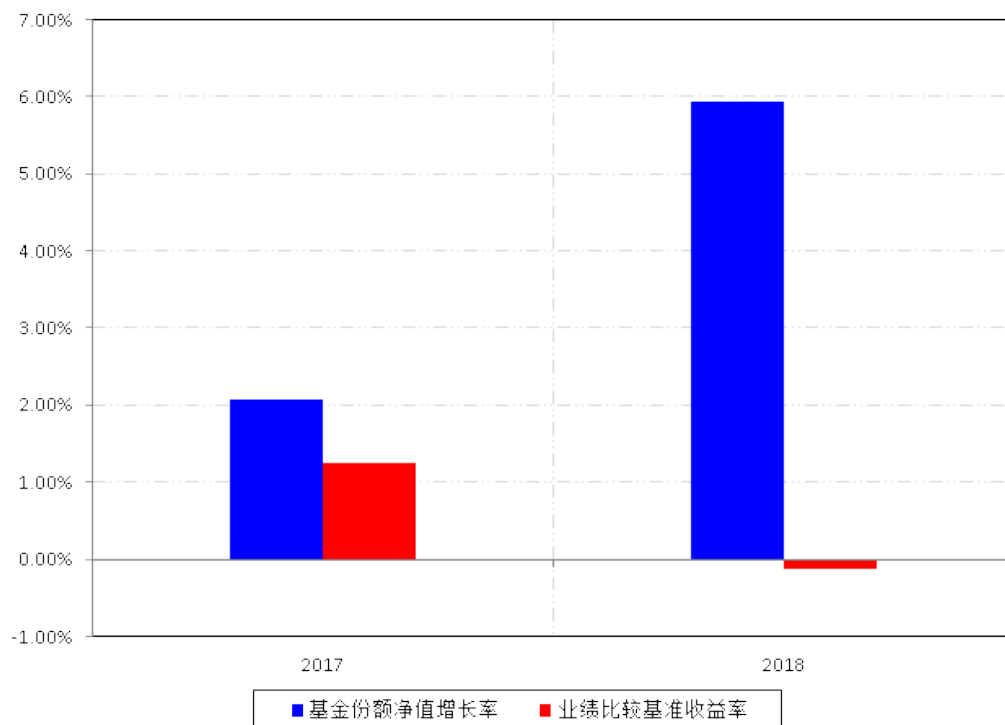


南方荣知定期开放混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

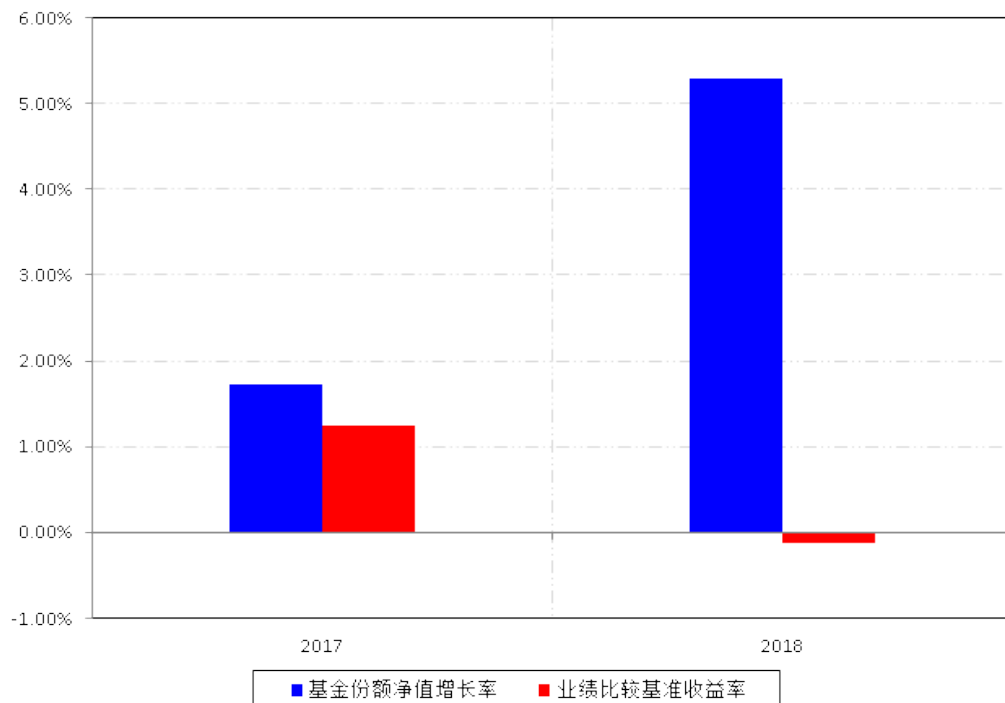


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方荣知定期开放混合A每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



南方荣知定期开放混合C每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2017 年 6 月 15 日成立，成立当年净值增长率按当年实际存续期计算，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 2017 年 6 月 15 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		
金凌志	本基金基金经理	2017 年 7 月 28 日	-	11 年	中央财经大学经济学硕士，具有基金从业资格。曾先后就职于中国出口信用保险公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、长盛基金、嘉实基金，历任项目经理、信用分析师、基金经理助理、投资经理。2017 年 5 月加入南方基金；2018 年 2 月至 2018 年 12 月，任南方和利基金经理；2017 年 7 月至今，任南方润元、南方荣知、南方纯元基金经理；2018 年 1 月至今，任南方卓利基金经理；2018 年 3 月至今，任南方乾利、南方浙利基金经理。
李璇	本基金基金经理（已离任）	2017 年 6 月 15 日	2018 年 7 月 27 日	11 年	女，清华大学金融学学士、硕士，注册金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2007 年加入南方基金，担任信用债高级分析师，现任固定收益投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员。2010 年 9 月至 2012 年 6 月，任南方宝元基金经理；2012 年 12 月至 2014 年 9 月，任南方安心基金经理；2015 年 12 月至 2017 年 2 月，任南方润元基金经理；2013 年 7 月至 2017 年 9 月，任南方稳利基金经理；2016 年 8 月至 2017 年 12 月，

					任南方通利、南方荣冠基金经理； 2016 年 8 月至 2018 年 2 月，任南方丰元基金经理；2016 年 11 月至 2018 年 2 月，任南方荣安基金经理；2017 年 1 月至 2018 年 7 月，任南方和利基金经理； 2017 年 3 月至 2018 年 7 月，任南方荣优基金经理；2017 年 5 月至 2018 年 7 月，任南方荣尊基金经理；2017 年 6 月至 2018 年 7 月，任南方荣知基金经理； 2017 年 7 月至 2018 年 7 月，任南方荣年基金经理；2010 年 9 月至今，任南方多利基金经理；2012 年 5 月至今，任南方金利基金经理；2016 年 9 月至今，任南方多元基金经理；2016 年 12 月至今，任南方睿见混合基金经理；2017 年 1 月至今，任南方宏元基金经理；2017 年 9 月至今，任南方兴利基金经理；2018 年 7 月至今，任南方配售基金经理。
--	--	--	--	--	---

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《南方荣知开放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年经济逐步下行，较2017年有显著回落，全年GDP增速从2017年的6.9%回落至6.6%。通胀方面，CPI在猪肉价格上涨叠加低基数的影响下，全年中枢小幅回升至2.1%，PPI在高基数和油价下跌的影响下，全年中枢回落至3.5%。金融数据方面，18年12月末M2增速降至8.1%，虽然信贷规模较17年有显著增长，但由于非标融资大幅减少，社融增速整体大幅下滑。

美联储2018年加息4次，不过美国经济开始呈现出衰退的迹象，美联储下调了对2019年的经济增长和通胀预测。欧洲经济同样出现放缓，欧央行下调了2019年对欧洲经济增长和通胀的预期。国内方面，央行的政策态度较2017年有较大转变，从偏紧的货币政策转向了中性偏松，并在年内大部分时间维持了合理充裕的流动性环境。2018年美元指数上涨4.14%，人民币对美元汇率中间价贬值3290个基点。

市场层面，2018年利率债收益率大幅下行，且短端下行幅度大于长端，收益率曲线呈现显著陡峭化。其中，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。信用债内部表现有所分化，城投表现略好于同期限金融债，中票表现弱于同期限金融债。权益市场方面，上证综指全年下跌25%左右。

投资运作上，南方荣知在2018年收益率下行期间积极参与中短端利率债波段操作，为组合贡献了很好的收益。2019年组合将坚持绝对收益操作策略，以信用债票息为主要收益来源，择机用股票、转债和利率债进行收益增强，以低风险、稳收益为主要操作目标，争取在2019年继续为持有人提供较好的收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金A份额净值为1.0811元，报告期内，份额净值增长率为5.93%，同期业绩基准增长率为-0.13%；本基金C份额净值为1.0711元，报告期内，份额净值增长率为5.29%，同期业绩基准增长率为-0.13%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年国内经济存在进一步下行的空间，海外央行货币政策趋紧对国内的掣肘也在逐步缓解。利率债方面，收益率中长期下行的时间和空间都还存在，2019 年利率债收益率整体或将继续下行，但下行的幅度难超越 2018 年。利率债的绝对收益率水平已经显著低于历史均值，且随着稳增长政策的持续发力，宽信用的效果或开始逐步显现，这将制约利率债收益率的大幅下行。信用债方面，2018 年信用债收益率下行的节奏较利率债偏慢，信用利差依然处于较高水平，因此存在一定利差收窄的空间。

#### 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同一类别的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；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；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，本基金已出现连续六十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，具体时间范围如下：

2018 年 06 月 25 日至 2018 年 12 月 31 日

## § 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合规守信、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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方荣知定期开放混合型证券投资基金 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 23190 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正文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：南方荣知定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	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	845,118.12	275,723.24
结算备付金	2,155,238.59	1,729,750.44
存出保证金	35,093.73	102,864.85
交易性金融资产	76,379,250.94	413,926,493.88

其中：股票投资	1,549,800.00	11,814,045.28
基金投资	-	-
债券投资	74,829,450.94	402,112,448.60
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	9,183,322.54	1,817,347.57
应收利息	1,649,821.93	7,084,832.54
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	90,247,845.85	424,937,012.52
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	32,299,865.15	83,999,695.00
应付证券清算款	9,239,540.15	1,327,787.70
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	24,565.40	172,312.01
应付托管费	6,141.34	43,078.00
应付销售服务费	15,406.78	128,464.63
应付交易费用	14,131.90	111,018.39
应交税费	3,154.28	-
应付利息	4,276.78	110,207.92
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	204,000.00	204,000.00
负债合计	41,811,081.78	86,096,563.65
所有者权益：		

实收基金	45,067,081.62	332,805,061.75
未分配利润	3,369,682.45	6,035,387.12
所有者权益合计	48,436,764.07	338,840,448.87
负债和所有者权益总计	90,247,845.85	424,937,012.52

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，南方荣知定期开放混合 A 份额净值 1.0811 元，基金份额总额 16,706,872.50 份；南方荣知定期开放混合 C 份额净值 1.0711 元，基金份额总额 28,360,209.12 份；总份额合计 45,067,081.62 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方荣知定期开放混合型证券投资基金

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 2018 年 1 月 1 日	上年度可比期间
	至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 6 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	10,511,594.33	11,070,484.97
1. 利息收入	11,158,134.10	8,895,137.99
其中：存款利息收入	53,085.79	1,084,368.49
债券利息收入	11,015,606.82	7,723,389.33
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	89,441.49	87,380.17
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-2,823,572.77	3,805,707.38
其中：股票投资收益	-1,350,354.28	4,229,393.55
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,520,474.21	-772,230.17
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	47,255.72	348,544.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,177,028.48	-1,630,360.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	4.52	-
减：二、费用	5,718,518.95	5,035,097.85
1. 管理人报酬	1,112,452.19	1,101,245.40
2. 托管费	278,112.94	275,311.36
3. 销售服务费	810,851.55	821,304.44
4. 交易费用	665,231.60	645,997.10
5. 利息支出	2,577,719.03	1,972,105.25
其中：卖出回购金融资产支出	2,577,719.03	1,972,105.25
6. 税金及附加	23,361.89	-
7. 其他费用	250,789.75	219,134.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	4,793,075.38	6,035,387.12
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	4,793,075.38	6,035,387.12

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方荣知定期开放混合型证券投资基金

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 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）	332,805,061.75	6,035,387.12	338,840,448.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	4,793,075.38	4,793,075.38



期利润)			
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)	-287,737,980.13	-7,458,780.05	-295,196,760.18
其中：1. 基金申购款	618,826.14	26,590.14	645,416.28
2. 基金赎回款	-288,356,806.27	-7,485,370.19	-295,842,176.46
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)	45,067,081.62	3,369,682.45	48,436,764.07
项目	上年度可比期间 2017 年 6 月 15 日(基金合同生效日)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)	332,805,061.75	-	332,805,061.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,035,387.12	6,035,387.12
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)	332,805,061.75	6,035,387.12	338,840,448.87

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

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。

#### 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 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.3.1 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	845,118.12	275,723.24
合计	845,118.12	275,723.24

#### 7.4.3.2 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	1,534,429.00	1,549,800.00	15,371.00	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	54,006,443.86	54,384,450.94	378,007.08
	银行间市场	20,291,710.00	20,445,000.00	153,290.00
	合计	74,298,153.86	74,829,450.94	531,297.08
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	75,832,582.86	76,379,250.94	546,668.08	
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	11,529,909.88	11,814,045.28	284,135.40	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	58,065,246.05	57,171,448.60	-893,797.45
	银行间市场	345,961,698.35	344,941,000.00	-1,020,698.35
	合计	404,026,944.40	402,112,448.60	-1,914,495.80
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	

其他	-	-	-
合计	415,556,854.28	413,926,493.88	-1,630,360.40

### 7.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

### 7.4.3.4 买入返售金融资产

#### 7.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

#### 7.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.3.5 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	131.58	114.10
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	969.80	778.40
应收债券利息	1,648,704.75	7,083,893.74
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	15.80	46.30
合计	1,649,821.93	7,084,832.54

### 7.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

### 7.4.3.7 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	8,967.45	98,063.15
银行间市场应付交易费用	5,164.45	12,955.24
合计	14,131.90	111,018.39

### 7.4.3.8 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
预提费用	204,000.00	204,000.00
合计	204,000.00	204,000.00

### 7.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

南方荣知定期开放混合 A		
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	84,497,485.38	84,497,485.38
本期申购	250,139.48	250,139.48
本期赎回（以“-”号填列）	-68,040,752.36	-68,040,752.36
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	16,706,872.50	16,706,872.50

金额单位：人民币元

南方荣知定期开放混合 C		
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	248,307,576.37	248,307,576.37
本期申购	368,686.66	368,686.66
本期赎回（以“-”号填列）	-220,316,053.91	-220,316,053.91
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	28,360,209.12	28,360,209.12

1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 根据《南方荣知定期开放混合型证券投资基金招募说明书》和《南方荣知定期开放混合型证券投资基金基金份额发售公告》的相关规定，本基金为定期开放基金，每年开放一次申购和赎回，每个开放期的起始日为基金合同生效日的年度对日（如该日为非工作日或无对应日期，则顺延至下一工作日），开放期不少于 5 个工作日并且最长不超过 20 个工作日。开放期内，投资人可以根据相关业务规则申购、赎回基金份额。本基金首个封闭期为自基金合同生效日（含该日）起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

### 7.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

南方荣知定期开放混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,157,168.39	-414,693.97	1,742,474.42
本期利润	954,742.51	754,429.97	1,709,172.48
本期基金份额交易产生的变动数	-2,288,314.08	191,230.38	-2,097,083.70
其中：基金申购款	8,547.18	2,027.75	10,574.93
基金赎回款	-2,296,861.26	189,202.63	-2,107,658.63

本期已分配利润	-	-	-
本期末	823,596.82	530,966.38	1,354,563.20

单位：人民币元

南方荣知定期开放混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,508,579.13	-1,215,666.43	4,292,912.70
本期利润	1,661,304.39	1,422,598.51	3,083,902.90
本期基金份额交易产生的变动数	-6,049,418.22	687,721.87	-5,361,696.35
其中：基金申购款	10,225.71	5,789.50	16,015.21
基金赎回款	-6,059,643.93	681,932.37	-5,377,711.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,120,465.30	894,653.95	2,015,119.25

## 7.4.3.11 存款利息收入

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 6 月 15 日（基金合同生效日） 至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	22,422.29	35,887.89
定期存款利息收入	-	1,030,750.00
结算备付金利息收入	29,394.50	17,197.37
其他	1,269.00	533.23
合计	53,085.79	1,084,368.49

## 7.4.3.12 股票投资收益

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 6 月 15 日（基金合同生效日） 至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	222,102,882.17	210,966,182.13
减：卖出股票成本总额	223,453,236.45	206,736,788.58
买卖股票差价收入	-1,350,354.28	4,229,393.55

## 7.4.3.13 债券投资收益

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 6 月 15 日（基金合同生效日） 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	943,371,723.42	98,566,155.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	919,179,008.80	97,670,449.98
减：应收利息总额	25,713,188.83	1,667,935.69
买卖债券差价收入	-1,520,474.21	-772,230.17

**7.4.3.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

**7.4.3.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

**7.4.3.16 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 6 月 15 日（基金合同生效日） 至 2017 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	47,255.72	348,544.00
合计	47,255.72	348,544.00

**7.4.3.17 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 6 月 15 日（基金合同生效日） 至 2017 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	2,177,028.48	-1,630,360.40
——股票投资	-268,764.40	284,135.40
——债券投资	2,445,792.88	-1,914,495.80
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-
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	2,177,028.48	-1,630,360.40

**7.4.3.18 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 6 月 15 日（基金合同生效日） 至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	4.52	-
合计	4.52	-

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

**7.4.3.19 交易费用**

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 6 月 15 日（基金合同生效日） 至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	657,656.60	640,197.10
银行间市场交易费用	7,575.00	5,800.00
合计	665,231.60	645,997.10

#### 7.4.3.20 其他费用

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 6 月 15 日（基金合同生效日） 至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	54,000.00	54,000.00
信息披露费	150,000.00	150,000.00
账户维护费	37,200.00	7,700.00
银行费用	9,589.75	7,434.30
合计	250,789.75	219,134.30

#### 7.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.5 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。



## 7.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.6.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 6 月 15 日（基金合同生效日）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	162,647,824.41	37.34%	45,899,300.82	10.69%

#### 7.4.6.1.2 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。

#### 7.4.6.1.3 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	146,044.39	37.04%	2,253.36	25.13%
兴业证券	-	-	-87.37	-0.97%
关联方名称	上年度可比期间 2017 年 6 月 15 日（基金合同生效日）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	41,652.88	10.66%	29,075.18	29.65%
兴业证券	-87.37	-0.02%	-87.37	-0.09%

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。

### 7.4.6.2 关联方报酬

#### 7.4.6.2.1 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 6 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,112,452.19	1,101,245.40
其中：支付销售机构的客户维护费	646,074.28	676,145.39

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 0.60% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.6.2.2 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 6 月 15 日（基金合同生效日） 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	278,112.94	275,311.36

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.6.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方荣知定期开放混合 A	南方荣知定期开放混合 C	合计
中国工商银行	-	803,526.97	803,526.97
南方基金	-	11.22	11.22
合计	-	803,538.19	803,538.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 6 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方荣知定期开放混合 A	南方荣知定期开放混合 C	合计
南方基金	-	5.97	5.97
中国工商银行	-	817,141.74	817,141.74
合计	-	817,147.71	817,147.71

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

**7.4.6.4.2 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**

无。

**7.4.6.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 6 月 15 日 (基金合同生效日) 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	845,118.12	22,422.29	275,723.24	35,887.89

注：本基金由基金托管人中国工商银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

**7.4.6.6 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。

**7.4.6.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.7 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**7.4.8 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.8.1 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：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113524	奇精转债	2018 年 12 月 17 日	2019 年 1 月 7 日	新债未上市	100.00	100.00	2,580	258,000.00	258,000.00	-

**7.4.8.2 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。

**7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.8.3.1 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 9,899,865.15 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
180409	18 农发 09	2019 年 1 月 2 日	102.17	100,000	10,217,000.00

### 7.4.8.3.2 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 22,400,000.00 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。

## 7.4.9 金融工具风险及管理

### 7.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 7.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风

险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 58.16%(2017 年 12 月 31 日：118.67%)。

### 7.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2018 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 32,299,865.15 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.53%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2018 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 7.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金和存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	845,118.12	-	-	-	845,118.12
结算备付金	2,155,238.59	-	-	-	2,155,238.59
存出保证金	35,093.73	-	-	-	35,093.73
交易性金融资产	16,007,472.74	56,494,567.00	2,327,411.20	1,549,800.00	76,379,250.94
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,649,821.93	1,649,821.93
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	9,183,322.54	9,183,322.54
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	19,042,923.1	56,494,567.0	2,327,411.20	12,382,944.4	90,247,845.8

	8	0		7	5
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	24,565.40	24,565.40
应付托管费	-	-	-	6,141.34	6,141.34
应付证券清算款	-	-	-	9,239,540.15	9,239,540.15
卖出回购金融资产款	32,299,865.15	-	-	-	32,299,865.15
应付销售服务费	-	-	-	15,406.78	15,406.78
应付交易费用	-	-	-	14,131.90	14,131.90
应付利息	-	-	-	4,276.78	4,276.78
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,154.28	3,154.28
其他负债	-	-	-	204,000.00	204,000.00
负债总计	32,299,865.15	-	-	9,511,216.63	41,811,081.78
利率敏感度缺口	-13,256,941.97	56,494,567.00	2,327,411.20	2,871,727.84	48,436,764.07
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	275,723.24	-	-	-	275,723.24
结算备付金	1,729,750.44	-	-	-	1,729,750.44
存出保证金	102,864.85	-	-	-	102,864.85
交易性金融资产	300,922,278.60	97,095,470.00	4,094,700.00	11,814,045.28	413,926,493.88
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	7,084,832.54	7,084,832.54
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,817,347.57	1,817,347.57
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	303,030,617.13	97,095,470.00	4,094,700.00	20,716,225.39	424,937,012.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人	-	-	-	172,312.01	172,312.01

报酬					
应付托管费	-	-	-	43,078.00	43,078.00
应付证券清算款	-	-	-	1,327,787.70	1,327,787.70
卖出回购金融资产款	83,999,695.00	-	-	-	83,999,695.00
应付销售服务费	-	-	-	128,464.63	128,464.63
应付交易费用	-	-	-	111,018.39	111,018.39
应付利息	-	-	-	110,207.92	110,207.92
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	204,000.00	204,000.00
负债总计	83,999,695.00	-	-	2,096,868.65	86,096,563.65
利率敏感度缺口	219,030,922.13	97,095,470.00	4,094,700.00	18,619,356.74	338,840,448.87

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-417,956.47	976,546.17
2.市场利率平行下降 25 个基点	422,341.40	-968,571.85	

#### 7.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围



的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为 0-30%。开放期内，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,549,800.00	3.20	11,814,045.28	3.49
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,549,800.00	3.20	11,814,045.28	3.49

#### 7.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.20% (2017 年 12 月 31 日：3.49%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2017 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.10 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 2,286,157.00 元，属于第二层次的余额为 74,093,093.94 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 18,478,515.28 元，第二层次 395,447,978.60 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	1,549,800.00	1.72
	其中：股票	1,549,800.00	1.72
2	固定收益投资	74,829,450.94	82.92
	其中：债券	74,829,450.94	82.92
	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	3,000,356.71	3.32
7	其他资产	10,868,238.20	12.04
8	合计	90,247,845.85	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	502,600.00	1.04
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	223,800.00	0.46
K	房地产业	823,400.00	1.70
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	1,549,800.00	3.20

## 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	000002	万科A	20,000	476,400.00	0.98
2	001979	招商蛇口	20,000	347,000.00	0.72
3	600872	中炬高新	10,000	294,600.00	0.61
4	601229	上海银行	20,000	223,800.00	0.46
5	600967	内蒙一机	20,000	208,000.00	0.43

## 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	000651	格力电器	8,748,198.00	2.58
2	600036	招商银行	7,889,578.75	2.33
3	600967	内蒙一机	7,428,545.00	2.19
4	601939	建设银行	6,851,840.00	2.02
5	600872	中炬高新	5,776,240.00	1.70
6	000858	五粮液	5,556,094.00	1.64
7	600019	宝钢股份	5,212,253.00	1.54
8	002152	广电运通	5,161,892.00	1.52
9	600887	伊利股份	5,041,560.71	1.49
10	600340	华夏幸福	4,746,970.89	1.40
11	000786	北新建材	4,717,068.00	1.39
12	000568	泸州老窖	4,606,864.00	1.36
13	601233	桐昆股份	4,179,784.00	1.23
14	600176	中国巨石	4,008,822.85	1.18
15	600809	山西汾酒	3,615,798.60	1.07
16	300136	信维通信	3,547,682.36	1.05
17	601229	上海银行	3,539,529.01	1.04
18	601100	恒立液压	3,521,038.00	1.04
19	002415	海康威视	3,438,076.27	1.01
20	002027	分众传媒	3,435,104.00	1.01

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	000651	格力电器	8,909,076.00	2.63
2	600036	招商银行	7,903,628.65	2.33
3	600967	内蒙一机	7,129,030.84	2.10
4	600872	中炬高新	6,793,274.70	2.00
5	601939	建设银行	6,645,900.00	1.96
6	600019	宝钢股份	6,590,512.00	1.95
7	000858	五粮液	5,789,200.00	1.71
8	601100	恒立液压	5,557,952.00	1.64
9	600176	中国巨石	5,502,091.00	1.62
10	002152	广电运通	5,367,960.59	1.58
11	600887	伊利股份	4,988,984.00	1.47
12	600340	华夏幸福	4,965,325.04	1.47
13	000568	泸州老窖	4,800,435.00	1.42
14	002419	天虹股份	4,747,061.43	1.40
15	000786	北新建材	4,667,200.88	1.38
16	601233	桐昆股份	4,350,853.00	1.28

17	600809	山西汾酒	3,890,323.80	1.15
18	002415	海康威视	3,413,554.66	1.01
19	002027	分众传媒	3,407,663.14	1.01
20	600862	中航高科	3,379,422.50	1.00

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	213,457,755.57
卖出股票收入（成交）总额	222,102,882.17

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	1,544,250.00	3.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	46,117,571.20	95.21
	其中：政策性金融债	45,113,471.20	93.14
4	企业债券	26,173,272.74	54.04
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	994,357.00	2.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	74,829,450.94	154.49

#### 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	108602	国开 1704	131,000	13,227,070.00	27.31
2	170412	17 农发 12	100,000	10,228,000.00	21.12
3	180409	18 农发 09	100,000	10,217,000.00	21.09
4	018006	国开 1702	95,000	9,699,500.00	20.03
5	122201	12 开滦 01	41,110	4,154,987.70	8.58

#### 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**

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 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	35,093.73
2	应收证券清算款	9,183,322.54

3	应收股利	-
4	应收利息	1,649,821.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,868,238.20

#### 8.12.4 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113018	常熟转债	327,510.00	0.68
2	128022	众信转债	292,857.00	0.60
3	123006	东财转债	115,990.00	0.24

#### 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

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
南方荣知定期开放混合 A	428	39,034.75	-	-	16,706,872.50	100.00%
南方荣知定期开放混合 C	414	68,502.92	-	-	28,360,209.12	100.00%
合计	842	53,523.85	-	-	45,067,081.62	100.00%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，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）。

### 9.2 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	南方荣知定期开放混合 A	97,077.95	0.5811%
从业人员持有本	南方荣知定期开放混合 C	-	-
基金	合计	97,077.95	0.5811%

### 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

项目	南方荣知定期开放混合 A	南方荣知定期开放混合 C
基金合同生效日(2017年6月15日)基金份额总额	84,497,485.38	248,307,576.37
本报告期期初基金份额总额	84,497,485.38	248,307,576.37
本报告期基金总申购份额	250,139.48	368,686.66
减：报告期基金总赎回份额	68,040,752.36	220,316,053.91
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	16,706,872.50	28,360,209.12

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未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 2 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	1	162,647,824.41	37.34%	146,044.39	37.04%	-
方正证券	1	108,997,991.63	25.03%	99,272.76	25.18%	-
海通证券	1	74,793,560.72	17.17%	67,802.28	17.20%	-
招商证券	1	69,565,062.25	15.97%	63,351.52	16.07%	-
中信证券	2	19,542,428.73	4.49%	17,792.66	4.51%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	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
华泰证券	95,019,939.95	17.04%	57,000,000.00	1.46%	-	-
方正证券	58,028,487.60	10.41%	431,600,000.00	11.09%	-	-
海通证券	345,985,839.50	62.06%	2,831,700,000.00	72.77%	-	-
招商证券	41,910,129.50	7.52%	420,400,000.00	10.80%	-	-
中信证券	16,548,011.10	2.97%	150,500,000.00	3.87%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-