

# 南方平衡配置混合型证券投资基金(原南方保本混合型证券投资基金) 2017 年年度报告

2017 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：2018 年 03 月 29 日

## 重要提示及目录

### 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 2018 年 3 月 26 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。

南方平衡配置混合型证券投资基金是根据原南方保本混合型证券投资基金《南方保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，由南方保本混合型证券投资基金转型而来。

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。

原南方保本混合型证券投资基金本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 7 月 14 日止，南方平衡配置混合型证券投资基金本报告期自 2017 年 7 月 15 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.2 基金基本情况（转型前）	6
2.3 基金产品说明（转型后）	6
2.4 基金产品说明（转型前）	7
2.5 基金管理人和基金托管人	7
2.6 信息披露方式	7
2.7 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现（转型后）	9
3.3 基金净值表现（转型前）	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型后）	13
3.5 过去三年基金的利润分配情况（转型前）	13
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 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	19
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
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	19
<b>§ 6 审计报告（转型后）</b>	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
<b>§ 7 审计报告（转型前）</b>	<b>22</b>
7.1 审计报告基本信息	22
7.2 审计报告的基本内容	22

§ 8 年度财务报表（转型后）	24
8.1 资产负债表	24
8.2 利润表	25
8.3 所有者权益（基金净值）变动表	26
8.4 报表附注	28
§ 9 年度财务报表（转型前）	51
9.1 资产负债表	51
9.2 利润表	53
9.3 所有者权益（基金净值）变动表	54
9.4 报表附注	55
§ 10 投资组合报告（转型后）	78
10.1 期末基金资产组合情况	78
10.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	78
10.3 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	79
10.4 报告期内股票投资组合的重大变动	80
10.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	82
10.6 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	82
10.7 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	83
10.8 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	83
10.9 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	83
10.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	83
10.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	83
10.12 投资组合报告附注	83
§ 11 投资组合报告（转型前）	84
11.1 期末基金资产组合情况	84
11.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	85
11.3 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	86
11.4 报告期内股票投资组合的重大变动	86
11.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	87
11.6 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	87
11.7 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	88
11.8 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	88
11.9 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	88
11.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	88
11.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	88
11.12 投资组合报告附注	89
§ 12 基金份额持有人信息（转型后）	90
12.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	90
12.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	90
12.3 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的情况	90
§ 13 基金份额持有人信息（转型前）	90

13.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	90
13.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	90
13.3 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的情况.....	91
<b>§ 14 开放式基金份额变动（转型后）.....</b>	<b>91</b>
<b>§ 15 开放式基金份额变动（转型前）.....</b>	<b>91</b>
<b>§ 16 重大事件揭示.....</b>	<b>92</b>
16.1 基金份额持有人大会决议.....	92
16.2 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.....	92
16.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	92
16.4 基金投资策略的改变.....	92
16.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	92
16.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	92
16.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）.....	93
16.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）.....	95
16.9 其他重大事件（转型后）.....	97
16.10 其他重大事件（转型前）.....	98
<b>§ 17 备查文件目录.....</b>	<b>99</b>
17.1 备查文件目录.....	99
17.2 存放地点.....	100
17.3 查阅方式.....	100

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	南方平衡配置混合型证券投资基金
基金简称	南方平衡配置混合
基金主代码	202212
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 7 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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	215,304,224.28 份
基金合同存续期	不定期

注:1. 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“南方平衡配置”。

2. 本基金转型日期为 2017 年 7 月 15 日, 该日起原南方保本混合型证券投资基金正式转型为南方平衡配置混合型证券投资基金。

### 2.2 基金基本情况（转型前）

基金名称	南方保本混合型证券投资基金
基金简称	南方保本混合
基金主代码	202212
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 6 月 21 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	273,498,399.64 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“南方保本”。

### 2.3 基金产品说明（转型后）

投资目标	根据对宏观经济形势的研究, 判断经济所处的经济周期阶段、景气循环状况和未来运行趋势, 积极把握股票、债券等市场发展趋势, 重点挖掘企业的核心竞争力, 在适度控制风险的前提下, 追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过把握对资本市场发展趋势的积极把握, 实现主动资产配置策略, 并且在资产配置基础上, 精选出具有核心竞争力的企业进行投资。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标, 同时根据需要进行积极操作, 以提高基金收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 $\times$ 50%+中证全债指数收益率 $\times$ 50%

风险收益特征	该基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金。
--------	--

## 2.4 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金按照恒定比例投资组合保险机制进行资产配置，在确保保本期到期时本金安全的基础上，力争基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金采用恒定比例投资组合保险策略（Constant-Proportion Portfolio Insurance, CPPI）来实现保本和增值的目标。
业绩比较基准	3 年期银行定期存款税后收益率+0.5%
风险收益特征	本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

## 2.5 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
注册地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		张海波	周慕冰

## 2.6 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

## 2.7 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商

		务大厦 31-33 层
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司	北京市海淀区西三环北陆 100 号金玉大厦写字楼 9 层

### § 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

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 07 月 15 日（自基金合同生效日）-2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,846,934.98
本期利润	3,552,813.43
加权平均基金份额本期利润	0.0153
本期加权平均净值利润率	1.02%
本期基金份额净值增长率	0.98%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末
期末可供分配利润	110,507,388.55
期末可供分配基金份额利润	0.5133
期末基金资产净值	325,187,113.55
期末基金份额净值	1.5104
3.1.3 累计期末指标	2017 年末
基金份额累计净值增长率	0.98%

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。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017 年 1 月 1 日 -2017 年 7 月 14 日）	报告期（2016 年 1 月 1 日 -2016 年 12 月 31 日）	报告期（2015 年 1 月 1 日 -2015 年 12 月 31 日）
本期已实现收益	39,792,498.29	47,935,409.18	135,020,104.73
本期利润	30,559,112.72	40,795,042.05	125,145,429.74
加权平均基金份额本期利润	0.0752	0.0921	0.2322

本期加权平均净值利润率	5.16%	6.76%	18.65%
本期基金份额净值增长率	5.28%	7.08%	19.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2017 年 7 月 14 日)	报告期(2016 年 12 月 31 日)	报告期(2015 年 12 月 31 日)
期末可供分配利润	136,352,309.42	176,195,101.33	153,005,976.76
期末可供分配基金份额利润	0.4985	0.4235	0.3262
期末基金资产净值	409,061,656.05	591,048,314.86	622,514,431.85
期末基金份额净值	1.496	1.421	1.327
3.1.3 累计期末指标	报告期(2017 年 7 月 14 日)	报告期(2016 年 12 月 31 日)	报告期(2015 年 12 月 31 日)
基金份额累计净值增长率	66.91%	58.54%	48.05%

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（转型后）

### 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	净值增长率①	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
2017.10.1-2017.12.31	0.35%	0.28%	2.19%	0.41%	-1.84%	-0.13%

自基金合同生效起至今	0.98%	0.20%	4.20%	0.36%	-3.22%	-0.16%
------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------

### 3.2.2 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

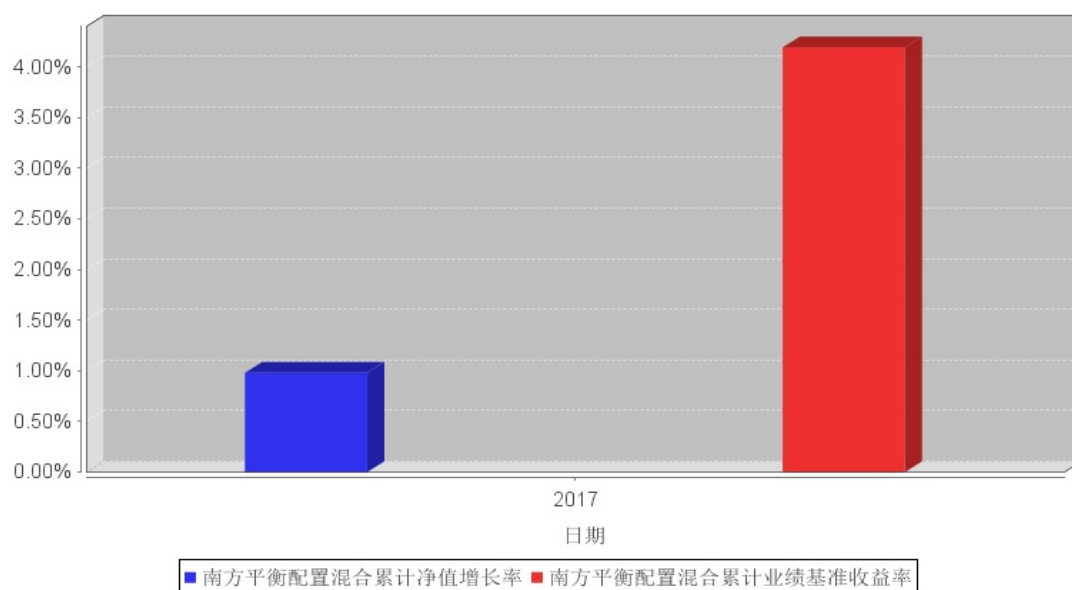
南方平衡配置混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 注：1. 本基金转型日期为2017年7月15日，截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。
2. 本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月，截止本报告期末建仓期未结束。

### 3.2.3 自基金转型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

南方平衡配置混合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



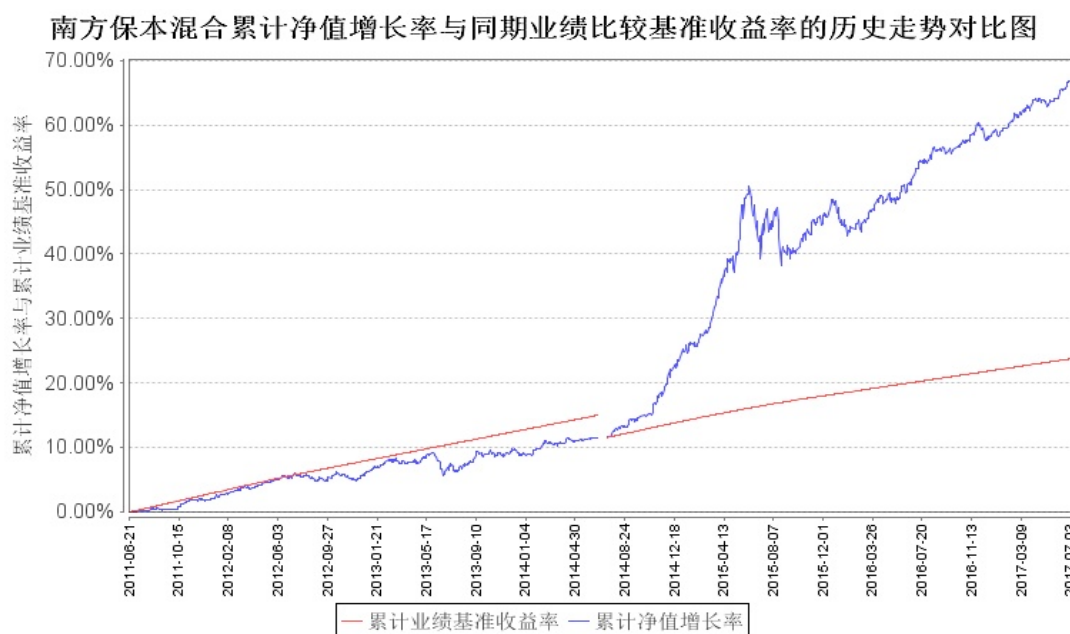
注：基金合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 基金净值表现（转型前）

#### 3.3.1 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

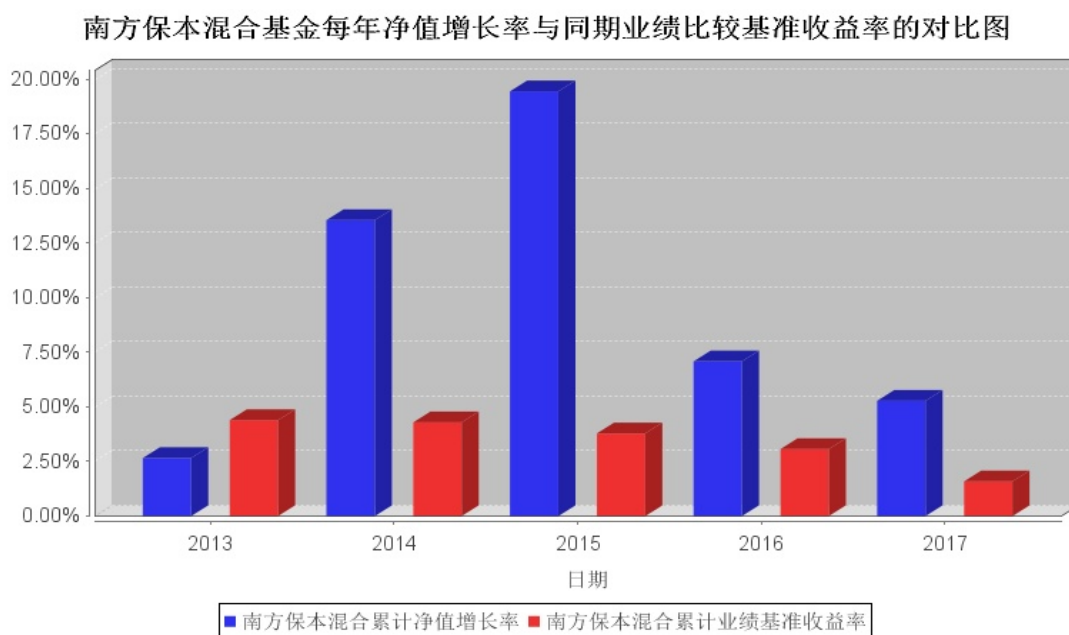
阶段	净值增长率 ① (%)	净值增长率标准差 ② (%)	业绩比较基准收益率 ③ (%)	业绩比较基准收益率标准差 ④ (%)	①— ③ (%)	②— ④ (%)
2017. 4. 1-2017. 7. 14	2.54	0.13	0.85	0.01	1.69	0.12
2017. 1. 1-2017. 7. 14	5.28	0.14	1.59	0.01	3.69	0.13
2016. 7. 1-2017. 7. 14	9.76	0.17	3.13	0.01	6.63	0.16
2014. 7. 11-2017. 7. 14	49.60	0.37	11.10	0.01	38.50	0.36
2012. 7. 1-2017. 7. 14	58.36	0.30	21.00	0.01	37.36	0.29
自基金合同生效起至 2017. 7. 14	66.91	0.28	27.80	0.01	39.11	0.27

### 3.3.2 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



注：本基金的第一个保本期为三年，自 2011 年 6 月 21 日至 2014 年 6 月 23 日止；第二个保本期为三年，自 2014 年 7 月 11 日至 2017 年 7 月 11 日止。

### 3.3.3 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



注：基金合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

注:无。

### 3.5 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

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

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超 7,200 亿元，旗下管理 153 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（转型后）

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		
黄春逢	本基金基金经理	2017 年 7 月 15 日	-	6	上海交通大学金融学硕士，具有基金从业资格。2011 年 7 月至 2014 年 12 月，任职于国泰君安研究所，担任银行业分析师；2015 年 1 月加入南方基金研究部，任金融行业高级研究员；2015 年 4 月至 2015 年 12 月，任南方避险、南方保本、南方利淘的基金经理助理；2015 年 5 月至 2015 年 12 月，任南方利鑫的基金经理助理；2015 年 6 月至 2015 年 12 月，任南方丰合的基金经理助理；2015 年 12 月至今，任南方成份基金经理；2017 年 7 月至今，任南方平衡配置基金经理；2017 年 8 月至今，任南方

					金融混合基金经理。
陈乐	本基金基金经理助理	2017年7月15日	2017年12月30日	9	北京大学金融学硕士，注册金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金，历任研究部研究员、高级研究员；2016年2月至2017年12月，任南方避险、南方平衡配置（原：南方保本）、南方利淘、南方利鑫、南方丰合、南方益和、南方瑞利的基金经理助理；2016年10月至2017年12月，任南方安泰养老基金经理助理；2016年12月至2017年12月，任南方安裕养老基金经理助理；2017年8月至2017年12月，任南方安睿混合基金经理助理。2017年12月至今，任南方瑞利混合基金经理。

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，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“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。

#### 4.1.3 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
孙鲁闽	本基金基金经理	2011年6月21日	2017年7月14日	14	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月加入南方基金管理有限公司，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；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；2015年5月至今，任南方丰合基金经理；2016年1月至今，任南方益和保本基金经理；2016年9月至今，任南方安泰养老基金经理；2016年11月至今，任南方安裕养老基金经理；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。
陈乐	本基	2016年	2017年7月	9	北京大学金融学硕士，注册金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金，历任

	基金 经理 助理	2 月 23 日	14 日		研究部研究员、高级研究员；2016 年 2 月至 2017 年 12 月，任南方避险、南方平衡配置（原：南方保本）、南方利淘、南方利鑫、南方丰合、南方益和、南方瑞利的基金经理助理；2016 年 10 月至 2017 年 12 月，任南方安泰养老基金经理助理；2016 年 12 月至 2017 年 12 月，任南方安裕养老基金经理助理；2017 年 8 月至 2017 年 12 月，任南方安睿混合基金经理助理。2017 年 12 月至今，任南方瑞利混合基金经理。
--	----------------	-------------	------	--	--

注：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，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方平衡配置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 5 次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数型基金成份股调整所致，相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

## 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

2017 年中国宏观经济维持稳中向好。从经济运行来看，全年 GDP 增速 6.9% 超市场预期，PMI 持续运行于荣枯线之上，12 月 PMI 大幅回升至 51.5%。从物价来看，12 月 CPI 同比增长 1.8% 维持较低水平，12 月 PPI 同比增速回落至 4.9%，通胀尚未对货币政策形成约束。央行于 9 月 30 日发布针对普惠金融贷款达标银行的定向降准政策，并于 12 月 29 日宣布建立“临时准备金动用安排”，允许在现金投放中占比较高的全国性商业银行在春节期间存在临时流动性缺口时，可临时使用不超过两个百分点的法定存款准备金。尽管这两项政策并不意味着货币政策由此转向宽松，但我们预计流动性进一步大幅收紧的概率正在下降。海外市场，美联储 12 月如期加息 25bp，而中国央行仅上调逆回购和 MLF 利率 5bp，国内流动性受海外市场的影响也在边际趋缓。

回顾组合操作，三、四季度本基金依然处于转型后的建仓期，大类资产配置更强调资产的安全性和稳定性。我们配置了一定比例的固定收益类资产，随着安全垫的积累，也稳步提升了权益类仓位的配置比例。在投资思路，我们继续围绕业绩的确定性寻找投资机会。重点布局了大金融、5G 通信、食品饮料等行业景气度较好的行业。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至转型后报告期末，本报告期（2017 年 7 月 15 日 — 2017 年 12 月 31 日）份额净值增长率 0.98%，业绩比较基准收益率 4.20%。

截至转型前报告期末，本报告期（2017 年 1 月 1 日 — 2017 年 7 月 14 日）份额净值增长率 5.28%，业绩比较基准收益率 1.59%。

## 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 2018 年，国内房地产库存水平处于低位，三架马车中投资向下有底，而海外经济复苏强劲，出口贸易也随之显著回暖，整体看国内经济依然具备较强韧性。流动性层面金融去杠杆初见成效，市场出现系统性风险的概率已显著下降，市场利率中枢进一步大幅上行的空间相对有限，而这或将带来市场估值以及风险偏好的整体修复，市场风格或将进一步趋向均衡。2018 年，A 股将首次纳入 MSCI 指数，预计低估值蓝筹和绩优白马仍将迎来持续的资金流入。同时，部分中上游周期行业在维持供给侧逻辑的同时，在经济企稳的背景下需求侧也存在一定的预期差，或将在上半年迎来景气度的持续提升。而随着利率环境企稳，部分估值合理的成长股的风险收益比也将逐步提升。2018 年我们将稳步提升权益类仓位，在行业配置上继续看好大金融、5G 通信、食品饮料和部分周期品，同时也将适度增加估值合理的成长股的配置。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展情况，坚持从保护基金持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础”的合规理念，继续致力于合规与内控机制的完善，积极推动主动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，并积极开展形式丰富的合规培训与考试，加强员工行为规范检查、加大合规问责力度，强化全员合规、主动合规理念；对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务开展了定期稽核、专项稽核及多项自查，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，排查业务中的风险点并完善内控措施，促进公司业务合规运作、稳健经营；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；积极参与新产品、新业务合规评估工作，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；继续按照风险为本的原则积极开展各项反洗钱工作，进一步升级反洗钱业务系统，优化其他反洗钱资源配置，重点推进《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》的具体落实工作，加强业务部门反洗钱风险评估频率，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度

度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金由南方保本于 2017 年 07 月 15 日正式转型而来：

##### （1）南方保本基金合同关于收益分配的表述

本基金的每份基金份额享有同等分配权；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于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；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；本基金仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资。转型为“南方平衡配置混合型证券投资基金”后，基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

##### （2）本基金合同关于收益分配的表述

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；若投资人选择不选择，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收益分配事项。

#### 4.9 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告（转型后）

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 22890 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方平衡配置混合型证券投资基金(原南方保本混合型证券投资基金)全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了南方平衡配置混合型证券投资基金(原南方保本混合型证券投资基金，以下简称“南方平衡配置混合基金”)的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年 7 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了南方平衡配置混合基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 7 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于南方平衡配置混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	南方平衡配置混合基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司，以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报

	<p>表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估南方平衡配置混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算南方平衡配置混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南方平衡配置混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对南方平衡配置混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致南方平衡配置混合基金不能持续经营。</p>

	(五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。	
	我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	陈熹
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2018 年 3 月 23 日	

## § 7 审计报告(转型前)

### 7.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 22747 号

### 7.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人:
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了南方保本混合型证券投资基金(以下简称“南方保本基金”)的财务报表,包括 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)的资产负债表,2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了南方保本基金 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一

	<p>步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于南方保本基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>南方保本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司，以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估南方保本基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算南方保本基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南方保本基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能导致对南方保本基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致南方保本基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露), 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	陈熹
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2018 年 3 月 23 日	

## § 8 年度财务报表(转型后)

### 8.1 资产负债表

会计主体: 南方平衡配置混合型证券投资基金(原南方保本混合型证券投资基金)

报告截止日: 2017 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
<b>资 产:</b>		
银行存款	8.4.7.1	10,423,128.51
结算备付金		6,462,528.71
存出保证金		94,374.89
交易性金融资产	8.4.7.2	282,943,913.50
其中: 股票投资		132,835,913.50
基金投资		—
债券投资		150,108,000.00
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	8.4.7.3	—

买入返售金融资产	8.4.7.4	24,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	8.4.7.5	2,946,915.05
应收股利		-
应收申购款		16,241.25
递延所得税资产		-
其他资产	8.4.7.6	-
资产总计		326,887,101.91
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	8.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		662,509.88
应付管理人报酬		418,820.54
应付托管费		69,803.43
应付销售服务费		-
应付交易费用	8.4.7.7	167,850.80
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	8.4.7.8	381,003.71
负债合计		1,699,988.36
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	8.4.7.9	214,679,725.00
未分配利润	8.4.7.10	110,507,388.55
所有者权益合计		325,187,113.55
负债和所有者权益总计		326,887,101.91

注:1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.5104 元, 基金份额总额 215,304,224.28 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 7 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

## 8.2 利润表

会计主体: 南方平衡配置混合型证券投资基金(原南方保本混合型证券投资基金)

本报告期: 2017 年 7 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 7 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		6,967,909.62
1. 利息收入		5,017,155.41
其中：存款利息收入	8.4.7.11	150,101.43
债券利息收入		2,682,179.74
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,184,874.24
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		210,779.56
其中：股票投资收益	8.4.7.12	19,839.83
基金投资收益		-
债券投资收益	8.4.7.13	116,810.13
资产支持证券投资	8.4.7.13.1	-
收益		-
贵金属投资收益	8.4.7.14	-
衍生工具收益	8.4.7.15	-
股利收益	8.4.7.16	74,129.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	8.4.7.17	1,705,878.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	8.4.7.18	34,096.20
<b>减：二、费用</b>		3,415,096.19
1. 管理人报酬	8.4.10.2.1	2,431,064.01
2. 托管费	8.4.10.2.2	405,177.31
3. 销售服务费	8.4.10.2.3	-
4. 交易费用	8.4.7.19	367,531.88
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	8.4.7.20	211,322.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,552,813.43
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,552,813.43

## 8.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方平衡配置混合型证券投资基金(原南方保本混合型证券投资基金)

本报告期：2017 年 7 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 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）	272,709,346.63	136,352,309.42	409,061,656.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	3,552,813.43	3,552,813.43
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）	-58,029,621.63	-29,397,734.30	-87,427,355.93
其中：			
1. 基金申购款	6,599,388.56	3,397,741.98	9,997,130.54
2. 基金赎回款	-64,629,010.19	-32,795,476.28	-97,424,486.47
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）	214,679,725.00	110,507,388.55	325,187,113.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 8.1 至 8.4 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

## 8.4 报表附注

### 8.4.1 基金基本情况

南方平衡配置混合型证券投资基金是根据原南方保本混合型证券投资基金(以下简称“南方保本混合基金”)《南方保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,由原南方保本混合基金转型而来。原南方保本混合基金为契约型开放式基金,存续期限不定,原南方保本混合基金第二个保本期于 2017 年 7 月 11 日到期,但基金管理人无法为基金转入下一保本期确定保本担保人,原南方保本混合基金不能满足继续作为法律法规规定的避险策略型基金运作的条件,基金管理人经与托管人协商一致,自 2017 年 7 月 15 日起,南方保本混合基金更名为南方平衡配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),《南方平衡配置混合型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为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),基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方平衡配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金可以投资于股票(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、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。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%—80%；债券、权证、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 20%—70%；现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%；基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 50%+中证全债指数收益率 $\times$ 50%。

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 2018 年 3 月 23 日批准报出。

#### 8.4.2 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》、《南方平衡配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 8.4.4 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。

#### 8.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 7 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 7 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 8.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 8.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 7 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日。

##### 8.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 8.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 8.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 8.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

- (1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。
- (2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。
- (3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 8.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 8.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 8.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累

计亏损)。

#### 8.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 8.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 8.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 8.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足

一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 8.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)于2017年12月25日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自2017年12月25日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 8.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 8.4.5.1 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。

### 8.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，本基金自2017年12月25日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

### 8.4.5.3 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。

## 8.4.6 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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 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。
- (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。

#### 8.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 8.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	10,423,128.51
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
存款期限小于 1 个月	—
存款期限 3 个月-1 年	—
其他存款	—
合计	10,423,128.51

##### 8.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	131,095,508.73	132,835,913.50	1,740,404.77
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	150,119,816.15	-11,816.15
	合计	150,119,816.15	-11,816.15
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	281,215,324.88	282,943,913.50	1,728,588.62

##### 8.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

## 8.4.7.4 买入返售金融资产

## 8.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	24,000,000.00	—
银行间买入返售证券	—	—
合计	24,000,000.00	—

## 8.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

## 8.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,625.73
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	2,908.20
应收债券利息	2,914,406.58
应收买入返售证券利息	27,932.04
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	42.50
合计	2,946,915.05

## 8.4.7.6 其他资产

注：无。

## 8.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	167,850.80
银行间市场应付交易费用	—
合计	167,850.80

## 8.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	3.71
预提费用	381,000.00
合计	381,003.71

## 8.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	273,498,399.64	272,709,346.63
本期申购	6,618,568.18	6,599,388.56
本期赎回（以“-”号填列）	-64,812,743.54	-64,629,010.19
本期末	215,304,224.28	214,679,725.00

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 根据《南方保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为南方平衡配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》，本基金由原南方保本混合型证券投资基金转型而来。转型方案实施后，基金份额持有人持有的原南方保本混合型证券投资基金份额转为南方平衡配置混合型证券投资基金份额。

3. 根据《南方保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为南方平衡配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》、《南方平衡配置混合型证券投资基金基金合同》、《南方平衡配置混合型证券投资基金招募说明书》和《南方平衡配置混合型证券投资基金开放日常申购、转换及

定投业务的公告》的相关规定，本基金于 2017 年 7 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 7 月 23 日止期间暂不向投资人开放基金申购和转换业务，申购和转换业务自 2017 年 7 月 24 日起开始办理。赎回业务自 2017 年 7 月 15 日(基金合同生效日)起正常办理。

#### 8.4.7.10 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
基金合同生效日	145,990,670.68	-9,638,361.26	136,352,309.42
本期利润	1,846,934.98	1,705,878.45	3,552,813.43
本期基金份额交易产生的变动数	-31,300,264.91	1,902,530.61	-29,397,734.30
其中：基金申购款	3,584,531.31	-186,789.33	3,397,741.98
基金赎回款	-34,884,796.22	2,089,319.94	-32,795,476.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	116,537,340.75	-6,029,952.20	110,507,388.55

#### 8.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 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	75,636.94
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	73,837.67
其他	626.82
合计	150,101.43

#### 8.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 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	78,323,998.13
减：卖出股票成本总额	78,304,158.30
买卖股票差价收入	19,839.83

## 8.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年7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	40,754,958.91
减：卖出债券（、债转股及债券到期 兑付）成本总额	40,034,181.65
减：应收利息总额	603,967.13
买卖债券差价收入	116,810.13

## 8.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：无。

## 8.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

## 8.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

## 8.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年7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	74,129.60
基金投资产 生的股利收 益	—
合计	74,129.60

## 8.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年7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	1,705,878.45

股票投资	1,717,694.60
债券投资	-11,816.15
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	-
-	-
其他	-
合计	1,705,878.45

#### 8.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	14,558.06
基金转换费收入	19,538.14
合计	34,096.20

注：1. 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。

2. 本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 8.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 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	365,856.88
银行间市场交易费用	1,675.00
合计	367,531.88

#### 8.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
----	---

审计费用	48,945.90
信息披露费	139,725.60
账户维护费	13,800.00
银行汇划费	8,851.49
合计	211,322.99

#### 8.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 8.4.8.1 或有事项

无。

##### 8.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 8.4.9 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。

#### 8.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 8.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 8.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 7 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（%）
华泰证券	55,288,660.34	19.23

#### 8.4.10.1.2 权证交易

注:无。

#### 8.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年7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	50,384.58	19.23	29,566.18	17.61

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 8.4.10.2 关联方报酬

##### 8.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 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	2,431,064.01
其中：支付销售机构的客户维护费	814,212.64

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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

## 8.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 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	405,177.31

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 0.25%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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

## 8.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

## 8.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

## 8.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

## 8.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

## 8.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

## 8.4.10.5 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 2017 年 7 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
中国农业银行	10,423,128.51	75,636.94

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。

#### 8.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

#### 8.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 8.4.11 利润分配情况

注:无。

#### 8.4.12 期末本基金持有的流通受限证券

##### 8.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

##### 8.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

##### 8.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 8.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

###### 8.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 8.4.13 金融工具风险及管理

##### 8.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型证券投资基金,预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金,低于股票基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理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从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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。

#### 8.4.13.2 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同责任，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农业银行，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 2017 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 27.76%。

#### 8.4.13.3 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可随时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 2017 年 12 月 31 日,本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 8.4.13.3.1 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》及《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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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公司的证券不得超过该证券的 10%,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 8.4.12。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%。

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。

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度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。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### 8.4.13.4 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。

##### 8.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

##### 8.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	10,423,128.51	-	-	-	10,423,128.51

结算备付金	6,462,528.71	-	-	-	6,462,528.71
存出保证金	94,374.89	-	-	-	94,374.89
交易性金融资产	150,108,000.00	-	-	132,835,913.50	282,943,913.50
买入返售金融资产	24,000,000.00	-	-	-	24,000,000.00
应收利息	-	-	-	2,946,915.05	2,946,915.05
应收申购款	-	-	-	16,241.25	16,241.25
资产总计	191,088,032.11	-	-	135,799,069.80	326,887,101.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	662,509.88	662,509.88
应付管理人报酬	-	-	-	418,820.54	418,820.54
应付托管费	-	-	-	69,803.43	69,803.43
应付交易费用	-	-	-	167,850.80	167,850.80
其他负债	-	-	-	381,003.71	381,003.71
负债总计	-	-	-	1,699,988.36	1,699,988.36
利率敏感度缺口	191,088,032.11	-	-	134,099,081.44	325,187,113.55

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。

#### 8.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
	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(2017年12月31日)

分析	1. 市场利率下降 25 个基点	82,463.32
	2. 市场利率上升 25 个基点	-82,317.32

#### 8.4.13.4.2 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。

#### 8.4.13.4.3 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：股票资产占基金资产的 30%—80%；债券、权证、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 20%—70%；现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%；基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。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。

##### 8.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	132,835,913.50	40.85
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	132,835,913.50	40.85

#### 8.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
	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（2017 年 12 月 31 日）
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	7,460,507.80
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-7,460,507.80

#### 8.4.14 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 2017 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 132,835,913.50 元,属于第二层次的余额为 150,108,000.00 元,无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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2017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。

(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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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》的规定,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。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,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。

此外,财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §9 年度财务报表(转型前)

### 9.1 资产负债表

会计主体:南方保本混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 7 月 14 日(基 金合同失效前日)	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	9.4.7.1	477,186,987.25	2,353,276.23
结算备付金		1,464,794.74	3,035,905.72
存出保证金		57,081.30	83,057.43
交易性金融资产	9.4.7.2	151,190.76	635,587,261.11
其中：股票投资		151,190.76	109,696,172.71
基金投资		-	-
债券投资		-	525,891,088.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	9.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	9.4.7.4	-	-
应收证券清算款		90,905.72	-
应收利息	9.4.7.5	30,545.43	10,575,319.75
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	9.4.7.6	-	-
资产总计		478,981,505.20	651,634,820.24
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 7 月 14 日(基 金合同失效前日)</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	9.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	59,400,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		69,399,839.57	-
应付管理人报酬		215,862.71	607,032.37
应付托管费		35,977.14	101,172.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	9.4.7.7	75,841.23	188,386.70
应交税费		-	-
应付利息		-	34,914.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	9.4.7.8	192,328.50	255,000.00

负债合计		69,919,849.15	60,586,505.38
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	9.4.7.9	272,709,346.63	414,853,213.53
未分配利润	9.4.7.10	136,352,309.42	176,195,101.33
所有者权益合计		409,061,656.05	591,048,314.86
负债和所有者权益总计		478,981,505.20	651,634,820.24

注:1. 报告截止日 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日), 基金份额净值 1.496 元, 基金份额总额 273,498,399.64 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)止期间。

## 9.2 利润表

会计主体: 南方保本混合型证券投资基金

本报告期: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 14 日(基金合 同失效前日)	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		36,799,092.70	53,753,942.80
1. 利息收入		8,369,056.82	21,624,787.03
其中: 存款利息收入	9.4.7.11	101,709.96	153,735.67
债券利息收入		6,970,043.82	21,308,582.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,297,303.04	162,469.02
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		37,636,895.56	39,205,376.80
其中: 股票投资收益	9.4.7.12	32,351,302.68	31,445,125.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	9.4.7.13	4,071,961.36	5,050,250.75
资产支持证券投资			
收益	9.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	9.4.7.14	-	-
衍生工具收益	9.4.7.15	-	-
股利收益	9.4.7.16	1,213,631.52	2,710,000.50
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	9.4.7.17	-9,233,385.57	-7,140,367.13
4. 汇兑收益(损失以“-”号		-	-

填列)			
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	9.4.7.18	26,525.89	64,146.10
减: 二、费用		6,239,979.98	12,958,900.75
1. 管理人报酬	9.4.10.2.1	3,754,514.18	7,239,543.18
2. 托管费	9.4.10.2.2	625,752.46	1,206,590.59
3. 销售服务费	9.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	9.4.7.19	610,133.23	1,236,950.31
5. 利息支出		1,020,596.19	2,875,431.60
其中: 卖出回购金融资产支出		1,020,596.19	2,875,431.60
6. 其他费用	9.4.7.20	228,983.92	400,385.07
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		30,559,112.72	40,795,042.05
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		30,559,112.72	40,795,042.05

### 9.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 南方保本混合型证券投资基金

本报告期: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)

单位: 人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)		
	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)	414,853,213.53	176,195,101.33	591,048,314.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	30,559,112.72	30,559,112.72
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)	-142,143,866.90	-70,401,904.63	-212,545,771.53
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-142,143,866.90	-70,401,904.63	-212,545,771.53

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）	272,709,346.63	136,352,309.42	409,061,656.05
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 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）	467,709,302.34	154,805,129.51	622,514,431.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	40,795,042.05	40,795,042.05
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）	-52,856,088.81	-19,405,070.23	-72,261,159.04
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-52,856,088.81	-19,405,070.23	-72,261,159.04
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）	414,853,213.53	176,195,101.33	591,048,314.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 9.1 至 9.4 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

## 9.4 报表附注

### 9.4.1 基金基本情况

南方保本混合型证券投资基金(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[2011]第 524 号《关于核准南方保本混合型证券投资基金募集的批复》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《南方保本混合型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,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 4,957,089,273.27 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 213 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方保本混合型证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,960,661,163.34 份基金份额,其中认购资金利息折合 3,571,890.07 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,担保人为中国投融资担保股份有限公司(原中国投资担保有限公司)。

根据本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2017 年 7 月 5 日发布的《南方保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为南方平衡配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》以及《关于修订〈南方保本混合证券投资基金基金合同〉的公告》,本基金第二个保本期于 2017 年 7 月 11 日到期,但基金管理人无法为本基金转入下一保本期确定保本担保人,本基金将不能满足继续作为法律法规规定的避险策略型基金运作的条件,基金管理人经与托管人协商一致,将按照本基金基金合同的约定转型为非保本的混合型基金,名称相应变更为“南方平衡配置混合型证券投资基金”,《南方平衡配置混合型证券投资基金基金合同》自 2017 年 7 月 15 日起生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金可以投资于股票(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、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。本基金的投资组合比例为:股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%;债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 60%;现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的投资目标为在严格控制风险的前提下,为投资者提供认购保本金额的保证,并在此基础上力争基金资产的稳定增值。在保本期到期日,如按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额,则基金管理人补足该差额,并由担保人提供不可撤销的连带责任担

保。本基金的业绩比较基准为：3 年期银行定期存款税后收益率+0.5%。

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 2018 年 3 月 23 日批准报出。

#### 9.4.2 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》、《南方保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 9.4.4 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。

经中国证监会批准,基金管理人南方基金管理股份有限公司将本基金于基金合同失效日转型为南方平衡配置混合型证券投资基金并相应延长存续期至不定期,因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

#### 9.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)止期间的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 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 9.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 9.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)。

##### 9.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 9.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持

有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 9.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 9.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 9.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 9.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于赎回引起的实收基金变动于基金赎回确认日认列。

#### 9.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 9.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价

值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 9.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 9.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 9.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 9.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的

指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 9.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 9.4.5.1 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。

##### 9.4.5.2 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。

##### 9.4.5.3 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。

#### 9.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。
- (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。

#### 9.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 9.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 7 月 14 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	477,186,987.25	2,353,276.23
定期存款	—	—
其中：存款期限小于 1 个月	—	—
存款期限 1-3 个月	—	—
存款期限 3 个月-1 年	—	—
其他存款	—	—
合计	477,186,987.25	2,353,276.23

##### 9.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 7 月 14 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	128,480.59	151,190.76	22,710.17
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	128,480.59	151,190.76	22,710.17
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	101,472,372.77	109,696,172.71	8,223,799.94
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	215,813,499.21	-928,410.81
	银行间市场	309,045,293.39	1,960,706.61
	合计	524,858,792.60	1,032,295.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	626,331,165.37	635,587,261.11	9,256,095.74

#### 9.4.7.3 衍生金融资产/负债

注:无。

#### 9.4.7.4 买入返售金融资产

##### 9.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注:无。

##### 9.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注:无。

## 9.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 7 月 14 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	28,041.28	1,234.39
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	2,437.99	1,366.20
应收债券利息	—	10,572,681.76
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	66.16	37.40
合计	30,545.43	10,575,319.75

## 9.4.7.6 其他资产

注：无。

## 9.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 7 月 14 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	74,104.97	187,436.70
银行间市场应付交易费用	1,736.26	950.00
合计	75,841.23	188,386.70

## 9.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 7 月 14 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	—	—
信息披露费	160,274.40	200,000.00
审计费	32,054.10	55,000.00
合计	192,328.50	255,000.00

## 9.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 7 月 14 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	416,008,733.84	414,853,213.53
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-142,510,334.20	-142,143,866.90
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	273,498,399.64	272,709,346.63

## 9.4.7.10 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	181,158,327.72	-4,963,226.39	176,195,101.33
本期利润	39,792,498.29	-9,233,385.57	30,559,112.72
本期基金份额交易产生的变动数	-74,960,155.33	4,558,250.70	-70,401,904.63
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-74,960,155.33	4,558,250.70	-70,401,904.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	145,990,670.68	-9,638,361.26	136,352,309.42

## 9.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 7 月 14 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	79,354.97	87,977.41
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	21,584.57	64,107.89
其他	770.42	1,650.37
合计	101,709.96	153,735.67

## 9.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 7 月 14 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	246,660,617.18	423,206,970.31
减：卖出股票成本 总额	214,309,314.50	391,761,844.76
买卖股票差价收入	32,351,302.68	31,445,125.55

#### 9.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年7月 14日	上年度可比期间 2016年1月1日 至 2016年 12月31日
卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成交总 额	1,184,931,699.93	401,302,273.58
减：卖出债券（、债转 股及债券到期兑付）成 本总额	1,154,254,880.43	385,391,192.59
减：应收利息总额	26,604,858.14	10,860,830.24
买卖债券差价收入	4,071,961.36	5,050,250.75

#### 9.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 9.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 9.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

#### 9.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 7 月 14 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收 益	1,213,631.52	2,710,000.50
基金投资产生的股利收	-	-

益		
合计	1,213,631.52	2,710,000.50

## 9.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 7 月 14 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-9,233,385.57	-7,140,367.13
股票投资	-8,201,089.77	3,421,287.88
债券投资	-1,032,295.80	-10,561,655.01
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	-	-
其他	-	-
合计	-9,233,385.57	-7,140,367.13

## 9.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 7 月 14 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	26,525.89	64,146.10
转换费	-	-
合计	26,525.89	64,146.10

注：根据《南方保本混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，在保本周期到期前赎回费率随申请份额持有时间增加而递减，赎回费归入基金资产的比例不得低于 50%。

## 9.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 7 月 14 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	604,120.73	1,233,000.31
银行间市场交易费用	6,012.50	3,950.00

合计	610,133.23	1,236,950.31
----	------------	--------------

#### 9.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 14 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	32,054.10	55,000.00
信息披露费	160,274.40	300,000.00
账户维护费	23,400.00	28,200.00
银行费用	13,255.42	17,185.07
合计	228,983.92	400,385.07

#### 9.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 9.4.8.1 或有事项

无。

##### 9.4.8.2 资产负债表日后事项

《南方保本混合型证券投资基金基金合同》自 2017 年 7 月 15 日起失效，《南方平衡配置混合型证券投资基金基金合同》于同一起生效，同时本基金更名为南方平衡配置混合型证券投资基金。

##### 9.4.9 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	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。

#### 9.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 9.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注:无。

##### 9.4.10.2 关联方报酬

###### 9.4.10.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 7 月 14 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,754,514.18	7,239,543.18
其中: 支付销售机构的客户维护费	1,208,932.40	2,309,029.81

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 1.20% 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  $\times$  1.20% / 当年天数。

###### 9.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 7 月 14 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	625,752.46	1,206,590.59

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 0.20% 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  $\times$  0.20% / 当年天数。

###### 9.4.10.2.3 销售服务费

注:无。

##### 9.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

## 9.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

## 9.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:无。

## 9.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:无。

## 9.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年7月 14日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	477,186,987.25	79,354.97	2,353,276.23	87,977.41

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

## 9.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

## 9.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 9.4.11 利润分配情况

注:无。

## 9.4.12 期末本基金持有的流通受限证券

## 9.4.12.1 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

9.4.12.1.1 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
603707	健友股份	2017-07-11	2017-07-19	新股未上市	7.21	7.21	2,185	15,753.85	15,753.85	-

9.4.12.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

9.4.12.1.3 受限证券类别：权证

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：份）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

9.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300100	双林股份	2017-04-05	重大资产重组	26.23	2017-10-12	28.56	800	21,456.00	20,984.00	
300267	尔康制药	2017-05-10	重大事项	11.46	2017-11-23	10.31	4,400	59,378.00	50,424.00	

注：本基金截至 2017 年 7 月 14 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。

9.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

9.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

9.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 9.4.13 金融工具风险及管理

#### 9.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只保本型证券投资基金。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从事风险管理的主要目标是在确保保本期到期时本金安全的基础上，力争基金资产的稳定增值。

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。

#### 9.4.13.2 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农业银行，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 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2016 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 82.21%)。

### 9.4.13.3 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可随时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 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 9.4.13.3.1 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》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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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公司的证券不得超过该证券的 10%。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 9.4.12。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。

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度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。

#### 9.4.13.4 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。

##### 9.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产及卖出回购金融资产等。

##### 9.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 7 月 14 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	477,186,987.25	-	-	-	477,186,987.25
结算备付金	1,464,794.74	-	-	-	1,464,794.74
存出保证金	57,081.30	-	-	-	57,081.30
交易性金融资产	-	-	-	151,190.76	151,190.76
应收证券清算款	-	-	-	90,905.72	90,905.72

应收利息	-	-	-	30,545.43	30,545.43
资产总计	478,708,863.29	-	-	272,641.91	478,981,505.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	69,399,839.57	69,399,839.57
应付管理人报酬	-	-	-	215,862.71	215,862.71
应付托管费	-	-	-	35,977.14	35,977.14
应付交易费用	-	-	-	75,841.23	75,841.23
其他负债	-	-	-	192,328.50	192,328.50
负债总计	-	-	-	69,919,849.15	69,919,849.15
利率敏感度缺口	478,708,863.29	-	-	-69,647,207.24	409,061,656.05
上年度末 2016 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	2,353,276.23	-	-	-	2,353,276.23
结算备付金	3,035,905.72	-	-	-	3,035,905.72
存出保证金	83,057.43	-	-	-	83,057.43
交易性金融资产	445,331,998.50	80,559,089.90	-	109,696,172.71	635,587,261.11
应收利息	-	-	-	10,575,319.75	10,575,319.75
资产总计	450,804,237.88	80,559,089.90	-	120,271,492.46	651,634,820.24
负债					
卖出回购金融资产款	59,400,000.00	-	-	-	59,400,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	607,032.37	607,032.37
应付托管费	-	-	-	101,172.07	101,172.07
应付交易费用	-	-	-	188,386.70	188,386.70
应付利息	-	-	-	34,914.24	34,914.24
其他负债	-	-	-	255,000.00	255,000.00
负债总计	59,400,000.00	-	-	1,186,505.38	60,586,505.38
利率敏感度缺口	391,404,237.88	80,559,089.90	-	-119,084,987.08	591,048,314.86

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。

#### 9.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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(2017年7月14日)	上年度末(2016年12月31日)
分析	市场利率下降	-	683,070.51

	25 个基点		
	市场利率上升		
	25 个基点	-	-679,527.02

#### 9.4.13.4.2 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。

#### 9.4.13.4.3 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、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 60%；现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。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。

##### 9.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 7 月 14 日	上年度末 2016 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	151,190.76	0.04	109,696,172.71	18.56
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	151,190.76	0.04	109,696,172.71	18.56

#### 9.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日),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 0.04%(2016 年 12 月 31 日: 18.56%),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(2016 年 12 月 31 日: 同)。

#### 9.4.14 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 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日),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 64,028.91 元,属于第二层次的余额为 87,161.85 元,无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日: 第一层次 97,349,430.06 元,第二层次 538,237,831.05 元,无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日),本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定,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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,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。

此外,财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 7 月 14 日(基金合同失效前日)止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 10 投资组合报告(转型后)

### 10.1 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	132,835,913.50	40.64
	其中：股票	132,835,913.50	40.64
2	固定收益投资	150,108,000.00	45.92
	其中：债券	150,108,000.00	45.92
	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	24,000,000.00	7.34
	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	16,885,657.22	5.17
7	其他各项资产	3,057,531.19	0.94
8	合计	326,887,101.91	100.00

## 10.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 10.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	81,798,913.50	25.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,118,000.00	0.96
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	2,293,500.00	0.71
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,038,600.00	1.55
J	金融业	31,640,900.00	9.73
K	房地产业	4,722,000.00	1.45
L	租赁和商务服务业	4,224,000.00	1.30
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	132,835,913.50	40.85

### 10.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 10.3 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

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	000063	中兴通讯	200,000	7,272,000.00	2.24
2	601009	南京银行	650,000	5,031,000.00	1.55
3	000786	北新建材	220,000	4,950,000.00	1.52
4	600887	伊利股份	150,000	4,828,500.00	1.48
5	000671	阳光城	600,000	4,722,000.00	1.45
6	600030	中信证券	250,000	4,525,000.00	1.39
7	002027	分众传媒	300,000	4,224,000.00	1.30
8	600519	贵州茅台	6,000	4,184,940.00	1.29
9	600487	亨通光电	100,000	4,042,000.00	1.24
10	600362	江西铜业	200,000	4,034,000.00	1.24
11	000895	双汇发展	150,000	3,975,000.00	1.22
12	000666	经纬纺机	200,000	3,884,000.00	1.19
13	300274	阳光电源	200,000	3,754,000.00	1.15
14	002517	恺英网络	160,000	3,553,600.00	1.09
15	000725	京东方 A	600,000	3,474,000.00	1.07
16	600183	生益科技	200,000	3,452,000.00	1.06
17	601233	桐昆股份	150,000	3,373,500.00	1.04
18	000001	平安银行	250,000	3,325,000.00	1.02
19	600900	长江电力	200,000	3,118,000.00	0.96
20	002281	光迅科技	100,000	2,940,000.00	0.90
21	600585	海螺水泥	100,000	2,933,000.00	0.90
22	600809	山西汾酒	50,000	2,849,500.00	0.88
23	601336	新华保险	40,000	2,808,000.00	0.86
24	000661	长春高新	15,000	2,745,000.00	0.84
25	002042	华孚色纺	200,000	2,678,000.00	0.82
26	601166	兴业银行	150,000	2,548,500.00	0.78
27	000768	中航飞机	150,000	2,533,500.00	0.78
28	600705	中航资本	450,000	2,484,000.00	0.76

29	601766	中国中车	200,000	2,422,000.00	0.74
30	603885	吉祥航空	150,000	2,293,500.00	0.71
31	600643	爱建集团	200,000	2,216,000.00	0.68
32	603515	欧普照明	50,000	2,142,000.00	0.66
33	601318	中国平安	30,000	2,099,400.00	0.65
34	601601	中国太保	50,000	2,071,000.00	0.64
35	300072	三聚环保	50,000	1,756,500.00	0.54
36	300308	中际旭创	29,991	1,754,473.50	0.54
37	600999	招商证券	100,000	1,716,000.00	0.53
38	600345	长江通信	60,000	1,669,800.00	0.51
39	603337	杰克股份	30,000	1,546,200.00	0.48
40	300440	运达科技	150,000	1,485,000.00	0.46
41	600109	国金证券	150,000	1,431,000.00	0.44
42	600958	东方证券	100,000	1,386,000.00	0.43
43	002247	帝龙文化	100,000	1,359,000.00	0.42
44	000821	京山轻机	100,000	1,246,000.00	0.38

#### 10.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 10.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	6,219,691.48	1.91
2	600519	贵州茅台	5,531,535.00	1.70
3	601009	南京银行	5,279,553.60	1.62
4	600585	海螺水泥	5,161,745.00	1.59
5	300274	阳光电源	5,142,972.39	1.58
6	000786	北新建材	4,893,949.00	1.50
7	600030	中信证券	4,572,131.00	1.41
8	000671	阳光城	4,563,588.77	1.40
9	600887	伊利股份	4,376,183.66	1.35
10	600362	江西铜业	4,295,340.00	1.32
11	000666	经纬纺机	4,197,994.81	1.29
12	002027	分众传媒	4,060,677.00	1.25
13	000895	双汇发展	4,033,771.50	1.24
14	600809	山西汾酒	3,780,309.00	1.16
15	000725	京东方 A	3,769,066.00	1.16
16	002517	恺英网络	3,720,897.00	1.14
17	600487	亨通光电	3,460,103.00	1.06
18	600900	长江电力	3,348,429.10	1.03

19	600183	生益科技	3,295,392.77	1.01
20	601233	桐昆股份	3,271,181.71	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。

#### 10.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	603160	汇顶科技	3,179,603.00	0.98
2	000333	美的集团	2,476,630.00	0.76
3	600519	贵州茅台	2,357,322.00	0.72
4	600585	海螺水泥	2,330,270.93	0.72
5	002304	洋河股份	2,212,312.80	0.68
6	000050	深天马 A	2,180,244.00	0.67
7	600525	长园集团	2,137,589.54	0.66
8	300059	东方财富	1,868,600.00	0.57
9	600622	光大嘉宝	1,764,435.32	0.54
10	002531	天顺风能	1,746,452.00	0.54
11	600297	广汇汽车	1,718,465.00	0.53
12	300274	阳光电源	1,525,640.00	0.47
13	600383	金地集团	1,512,066.88	0.46
14	002035	华帝股份	1,485,062.00	0.46
15	002384	东山精密	1,457,522.76	0.45
16	002236	大华股份	1,402,930.00	0.43
17	600276	恒瑞医药	1,400,000.00	0.43
18	600019	宝钢股份	1,320,183.00	0.41
19	600388	龙净环保	1,291,583.00	0.40
20	601600	中国铝业	1,253,600.00	0.39

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。

#### 10.4.3 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	209,271,186.44
卖出股票收入(成交)总额	78,323,998.13

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。

## 10.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	59,838,000.00	18.40
	其中：政策性金融债	59,838,000.00	18.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	90,270,000.00	27.76
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	150,108,000.00	46.16

## 10.6 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（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	011751074	17 大唐集 SCP006	300,000	30,084,000.00	9.25
2	011756037	17 华电 SCP010	300,000	30,063,000.00	9.24
3	150207	15 国开 07	300,000	29,982,000.00	9.22
4	170207	17 国开 07	300,000	29,856,000.00	9.18
5	011751029	17 宁沪高 SCP001	200,000	20,116,000.00	6.19

## 10.7 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。

## 10.8 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。

## 10.9 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。

## 10.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 10.10.1 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。

### 10.10.2 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。

## 10.11 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。

## 10.12 投资组合报告附注

### 10.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体除中信证券(600030),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。根据2017年5月24日中信证券股份有限公司(下称中信证券,股票代码:600030)《中信证券股份有限公司关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》,中信证券近日收到了《行政处罚事先告知书》(处罚字

[2017]57号),依据《证券公司监督管理条例》相关规定,中国证监会拟决定责令中信证券改正,给予警告,没收违法所得人民币61,655,849.78元,并处人民币308,279,248.90元罚款。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 10.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

### 10.12.3 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	94,374.89
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,946,915.05
5	应收申购款	16,241.25
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,057,531.19

#### 10.12.4 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。

#### 10.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 11 投资组合报告（转型前）

#### 11.1 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	151,190.76	0.03
	其中：股票	151,190.76	0.03
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	478,651,781.99	99.93
7	其他各项资产	178,532.45	0.04
8	合计	478,981,505.20	100.00

## 11.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 11.2.1 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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	151,190.76	0.04
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	—	—
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	151,190.76	0.04

### 11.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

## 11.3 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

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	300267	尔康制药	4,400	50,424.00	0.01
2	603305	旭升股份	1,351	32,059.23	0.01

3	603757	大元泵业	744	31,969.68	0.01
4	300100	双林股份	800	20,984.00	0.01
5	603707	健友股份	2,185	15,753.85	0.00

## 11.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 11.4.1 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	600036	招商银行	3,814,433.00	0.65
2	601169	北京银行	3,664,535.00	0.62
3	002242	九阳股份	2,999,352.60	0.51
4	000786	北新建材	2,986,683.29	0.51
5	000404	华意压缩	2,723,699.00	0.46
6	600004	白云机场	2,557,456.00	0.43
7	600511	国药股份	2,250,441.00	0.38
8	002142	宁波银行	2,194,568.00	0.37
9	600153	建发股份	2,177,610.00	0.37
10	002185	华天科技	2,098,349.30	0.36
11	002191	劲嘉股份	2,009,355.00	0.34
12	002027	分众传媒	1,907,939.00	0.32
13	002317	众生药业	1,863,834.00	0.32
14	600409	三友化工	1,806,024.00	0.31
15	000581	威孚高科	1,780,144.31	0.30
16	603368	柳州医药	1,737,182.80	0.29
17	600690	青岛海尔	1,729,876.00	0.29
18	600741	华域汽车	1,655,708.00	0.28
19	002511	中顺洁柔	1,618,179.36	0.27
20	300258	精锻科技	1,554,847.02	0.26

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。

### 11.4.2 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	000786	北新建材	9,107,797.82	1.54
2	600511	国药股份	8,662,055.00	1.47
3	000333	美的集团	8,014,190.55	1.36
4	600266	北京城建	7,323,432.99	1.24
5	601166	兴业银行	6,377,906.48	1.08

6	000895	双汇发展	6,092,960.87	1.03
7	600741	华域汽车	5,661,186.54	0.96
8	601098	中南传媒	5,328,462.30	0.90
9	002792	通宇通讯	4,701,158.00	0.80
10	600036	招商银行	4,246,929.00	0.72
11	600068	葛洲坝	3,920,974.30	0.66
12	600153	建发股份	3,909,499.00	0.66
13	002142	宁波银行	3,803,068.73	0.64
14	000651	格力电器	3,782,083.29	0.64
15	600519	贵州茅台	3,746,765.80	0.63
16	601169	北京银行	3,583,980.00	0.61
17	000921	海信科龙	3,405,526.00	0.58
18	002242	九阳股份	3,197,013.33	0.54
19	600004	白云机场	3,009,246.00	0.51
20	600567	山鹰纸业	2,543,136.96	0.43

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。

#### 11.4.3 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	112,965,422.32
卖出股票收入(成交)总额	246,660,617.18

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。

#### 11.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

#### 11.6 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

注:本基金本报告期末未持有债券。

#### 11.7 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。

#### 11.8 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。

## 11.9 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。

## 11.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 11.10.1 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。

### 11.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货的投资应符合基金合同规定的保本策略和投资目标。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,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。(1) 利用股指期货调整风险资产的比例 本基金管理人将根据 CPPI 策略与市场的变化不断调整风险资产和安全资产之间的比例。在需要调整风险资产的头寸时,本基金将适当通过买卖股指期货对风险资产头寸进行调整。当需要增加风险资产头寸时,可根据相应的  $\beta$  值建立股指期货多头头寸;反之,当需要降低风险资产头寸时,可根据相应的  $\beta$  值建立股指期货空头头寸。(2) 调整投资组合的  $\beta$  值 风险资产的  $\beta$  值是决定组合表现的重要因素,基金管理人将通过在弱市中降低风险资产组合的  $\beta$  值,在强市中提高风险资产组合的  $\beta$  值,以提升组合的业绩表现。基金管理人将通过建立多头或者空头股指期货头寸实现对风险资产组合  $\beta$  值的控制。(3)  $\alpha$  策略 在投资组合中分离出系统风险,寻求具有长期稳定的超额收益的投资品种,并利用股指期货规避系统风险。本基金管理人正式投资股指期货前将与担保人协商确定股指期货相关风险控制流程。本基金的股指期货投资将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

## 11.11 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。

## 11.12 投资组合报告附注

### 11.12.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

## 11.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

## 11.12.3 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	57,081.30
2	应收证券清算款	90,905.72
3	应收股利	—
4	应收利息	30,545.43
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	178,532.45

## 11.12.4 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。

## 11.12.5 期末前十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	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300267	尔康制药	50,424.00	0.01	重大事项
2	300100	双林股份	20,984.00	0.01	重大资产重组
3	603707	健友股份	15,753.85	0.00	新股申购

## § 12 基金份额持有人信息（转型后）

## 12.1 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 (%)
5,977	36,022.12	1,668,475.98	0.77	213,635,748.30	99.23

## 12.2 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	776,742.41	0.3608

## 12.3 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的情况

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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 13 基金份额持有人信息（转型前）

## 13.1 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（%）
6,735	40,608.52	2,665,516.49	0.97	270,832,883.15	99.03

## 13.2 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	852,564.38	0.3117

## 13.3 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的情况

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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## § 14 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2017 年 7 月 15 日） 基金份额总额	273,498,399.64
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	6,618,568.18
减：基金合同生效日起至报告期期末 基金总赎回份额	64,812,743.54
基金合同生效日起至报告期期末基金 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	215,304,224.28

## § 15 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

基金合同生效日（2011 年 6 月 21 日） 基金份额总额	4,960,661,163.34
本报告期期初基金份额总额	416,008,733.84
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	142,510,334.20
本报告期基金拆分变动份额（份额减 少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	273,498,399.64

## § 16 重大事件揭示

## 16.1 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。

## 16.2 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

2017 年 1 月 23 日南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议，审议通过秦长奎因任期

届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

2017 年 12 月 8 日南方基金管理股份有限公司（筹）第一届董事会第一次会议，审议通过聘任史博担任公司副总经理。

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

### 16.3 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。

### 16.4 基金投资策略的改变

南方平衡配置混合型证券投资基金是根据原南方保本混合型证券投资基金《南方保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，由南方保本混合型证券投资基金转型而来。转型前基金投资策略见 2.4；转型后基金投资策略见 2.3。

### 16.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，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 81,000.00 元，该审计机构已提供南方保本混合型证券投资基金审计服务的连续年限为 7 年，提供南方平衡配置混合型证券投资基金审计服务的连续年限为 1 年。

### 16.6 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。

### 16.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

#### 16.7.1 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 (%)	
东兴 证券	1	72,685,65 8.12	25.28	66,238.91	25.28	
华泰 证券	1	55,288,66 0.34	19.23	50,384.58	19.23	
招商 证券	1	50,802,80 5.63	17.67	46,296.82	17.67	
东方 证券	1	45,095,39 8.38	15.68	41,094.79	15.68	
国泰 君安	1	27,622,51 3.56	9.61	25,171.80	9.61	
江海 证券	1	27,196,39 6.60	9.46	24,784.17	9.46	
中泰 证券	1	5,020,541 .00	1.75	4,575.49	1.75	
中天 证券	1	3,817,854 .90	1.33	3,479.02	1.33	
瑞银 证券	1	—	—	—	—	
英大 证券	1	—	—	—	—	
川财 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。

## 16.7.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	3,328,000,000.00	34.02	-	-	-	-
东兴证券	-	-	2,946,400,000.00	30.11	-	-	-	-
国泰君安	-	-	2,695,000,000.00	27.55	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	380,500,000.00	3.89	-	-	-	-
中天证券	-	-	434,000,000.00	4.44	-	-	-	-

## 16.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

### 16.8.1 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	
招商证券	1	184,072,684.18	51.75%	167,746.61	51.51%	
国泰君安	1	75,549,465.00	21.24%	68,921.40	21.16%	
中泰证券	1	42,857,369.76	12.05%	39,725.87	12.20%	
东方证券	1	22,395,398.32	6.30%	20,833.98	6.40%	
东兴证券	1	16,750,742.32	4.71%	15,562.63	4.78%	
中天证券	1	11,108,826.70	3.12%	10,124.09	3.11%	
英大证券	1	2,930,384.00	0.82%	2,724.08	0.84%	
瑞银证券	1	-	-	-	-	
华泰证券	1	-	-	-	-	
川财证券	1	-	-	-	-	
江海证券	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。

## 16.8.2 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
川财证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	22,450,241.00	8.84%	223,000,000.00	5.50%	—	—
东兴证券	37,069,731.80	14.59%	808,100,000.00	19.95%	—	—
国泰君安	9,505,012.19	3.74%	2,140,000,000.00	52.83%	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
江海证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
英大证券	4,977,500.00	1.96%	21,000,000.00	0.52%	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	180,008,185.10	70.87%	662,000,000.00	16.34%	—	—
中天证	—	—	197,000,000.00	4.86%	—	—

券						
---	--	--	--	--	--	--

## 16.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方平衡配置混合型证券投资基金开放日常申购、转换及定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 07 月 21 日
2	南方保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2017 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 07 月 27 日
3	南方保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 07 月 27 日
4	南方基金关于旗下部分基金增加青岛农商银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 09 月 08 日
5	南方基金关于旗下部分基金增加华林证券为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 09 月 13 日
6	南方基金关于旗下部分基金增加联储证券为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 10 月 13 日
7	南方基金关于旗下部分基金增加晋中银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 11 月 24 日
8	南方基金关于旗下部分基金增加川财证券为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 14 日
9	南方基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 26 日
10	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 29 日
11	南方基金关于旗下部分基金参加邮储银行个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 29 日
12	南方基金管理有限公司关于公司旗下证券投资基金缴纳增值税及其附加税费的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 30 日
13	南方基金关于旗下部分基金参加	中国证券报、上海	2017 年 12 月 30 日

	交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证券报、证券时报	
--	--------------------------------	----------	--

#### 16.10 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于旗下部分基金增加金斧子为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 01 月 06 日
2	南方基金关于旗下部分基金增加肯特瑞财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 01 月 11 日
3	南方保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2016 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 01 月 23 日
4	南方保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2016 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 01 月 23 日
5	南方基金关于旗下部分基金增加植信基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 02 月 15 日
6	南方基金关于旗下部分基金增加中原银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 02 月 23 日
7	南方基金关于旗下部分基金增加萧山农商银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 03 月 06 日
8	南方基金关于旗下部分基金增加华夏财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 03 月 15 日
9	南方基金关于旗下部分基金增加成都农商银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 03 月 27 日
10	南方基金关于旗下部分基金增加大河财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 04 月 06 日
11	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 05 月 10 日
12	南方基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低申购金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 06 月 12 日
13	南方平衡配置混合型证券投资基金基金合同	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 07 月 05 日

14	关于南方保本混合型证券投资基金到期转型后变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 07 月 05 日
15	南方平衡配置混合型证券投资基金托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 07 月 05 日
16	南方平衡配置混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 07 月 05 日
17	南方保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为南方平衡配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 07 月 05 日
18	关于修订《南方保本混合证券投资基金基金合同》的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 07 月 05 日
19	《南方保本混合型证券投资基金基金合同》与《南方平衡配置混合型证券投资基金基金合同》条文对照表	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 07 月 05 日
20	南方保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为南方平衡配置混合型证券投资基金相关业务规则的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 07 月 07 日
21	南方保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为南方平衡配置混合型证券投资基金相关业务规则的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 07 月 11 日
22	南方保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为南方平衡配置混合型证券投资基金相关业务规则的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 07 月 14 日

## § 17 备查文件目录

### 17.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方保本混合型证券投资基金的文件。
- 2、南方保本混合型证券投资基金基金合同。
- 3、南方保本混合型证券投资基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立南方平衡配置混合型证券投资基金的文件。
- 5、南方平衡配置混合型证券投资基金基金合同。
- 6、南方平衡配置混合型证券投资基金托管协议。
- 7、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

## 17.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

## 17.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>