

# 南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资 基金 2018 年半年度报告（摘要）

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 27 日

## 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	南方中证 1000ETF
场内简称	1000ETF
基金主代码	512100
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	149,892,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 11 月 4 日

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“1000ETF”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数

	中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 1000 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	张燕
	联系电话	0755-82763888	0755-83199084
	电子邮箱	manager@southernfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95555
传真		0755-82763889	0755-83195201

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 01 月 01 日-2018 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	-5,589,907.31
本期利润	-19,697,572.94
加权平均基金份额本期利润	-0.1510
本期基金份额净值增长率	-18.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 06 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3326
期末基金资产净值	100,037,443.32
期末基金份额净值	0.6674

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. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

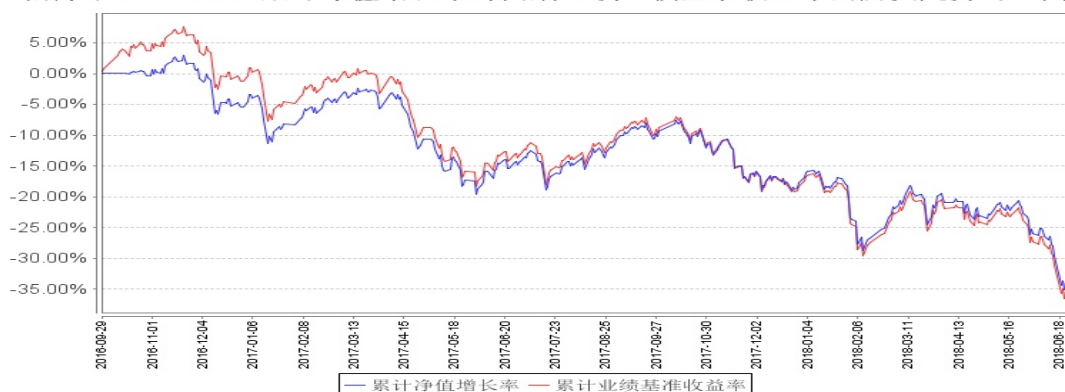
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-10.79%	1.97%	-11.19%	1.97%	0.40%	0.00%
过去三个月	-16.63%	1.45%	-17.51%	1.46%	0.88%	-0.01%
过去六个月	-18.83%	1.50%	-20.08%	1.50%	1.25%	0.00%
过去一年	-22.11%	1.26%	-24.88%	1.27%	2.77%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-33.26%	1.15%	-34.72%	1.17%	1.46%	-0.02%

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

南方中证1000ETF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



## § 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）管理资产规模近 7,800 亿元，旗下管理 167 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周豪	本基金基金经理	2016 年 9 月 29 日		9	北京大学软件工程专业硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金信息技术部，长期负责指数基金及 ETF 基金的投研及系统支持工作；2015 年 6 月，任数量化投资部高级研究员；2016 年 4 月至今，任 500 工业 ETF、500 原材料 ETF 基金经理；2016 年 8 月至今，任 380ETF、南方 380、小康 ETF、南方小康、互联基金基金经理；2016 年 9 月至今，任 1000ETF 基金经理；2017 年 8 月至今，任南方有色金属基金经理；2017 年 9 月至今，任南方有色金属联接基金经理；2018 年 1 月至今，任南方中证 100 基金经理；2018 年 2 月至今，任南方消费活力基金经理。

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《南方中证 1000 交易型开放式指数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。

#### 4.3.2 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均未超过该证券当日成交量的 5%。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内中证 1000 指数下跌 20.08%。期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF 现金流精算系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本 ETF 基金的安全运作。我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：（1）申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；（2）报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离。（3）根据指数每半年度成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.6674 元，报告期内，份额净值增长率为-18.83%，同期业绩基准增长率为-20.08%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观来看，国内经济增速预计平稳回落，企业盈利小幅下行，利率水平在外围美联储加息、内在降成本需求下，预计边际有所放松但空间不大，政策重点还是调结构、防风险。中美贸易冲突预计仍有反复，不过冲突继续扩大的可能性较小，且市场预期已较为充分，料相关因素影响将减弱。证券市场经过调整，风险得到一定释放，配置价值在提升，同时近期政策面也释放出积极信号，预计市场短期将迎来一定机会。本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、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。

#### 4.7 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，当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；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，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采取现金分红方式；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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份

额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	2,355,815.60	1,897,658.96
结算备付金	624,572.52	930,130.62
存出保证金	412,870.94	505,212.60
交易性金融资产	97,207,328.97	98,025,108.84
其中：股票投资	97,204,649.75	97,967,998.40
基金投资	-	-
债券投资	2,679.22	57,110.44
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	-	-
应收利息	729.65	949.92
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-



其他资产	-	-
资产总计	100,601,317.68	101,359,060.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018年6月30日</b>	<b>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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	50,125.60	291.71
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	41,007.42	40,949.71
应付托管费	8,201.48	8,189.96
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,319.99	5,298.80
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	460,219.87	259,971.59
负债合计	563,874.36	314,701.77
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	149,892,000.00	122,892,000.00
未分配利润	-49,854,556.68	-21,847,640.83
所有者权益合计	100,037,443.32	101,044,359.17
负债和所有者权益总计	100,601,317.68	101,359,060.94

注： 报告截止日 2018 年 06 月 30 日，基金份额总额 149,892,000.00 份，基金份额净值 0.6674 元。

## 6.2 利润表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
一、收入	-19,043,899.42	-9,892,787.18
1. 利息收入	16,540.91	15,379.61
其中：存款利息收入	16,465.16	15,373.26
债券利息收入	75.75	6.35
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-

其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-5,090,109.72	-3,263,221.77
其中：股票投资收益	-5,572,946.30	-3,725,788.09
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,589.69	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-152,520.00	26,160.00
股利收益	638,946.27	436,406.32
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-14,107,665.63	-6,715,379.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	137,335.02	70,434.43
减：二、费用	653,673.52	816,279.83
1. 管理人报酬	249,207.44	324,752.72
2. 托管费	49,841.48	64,950.50
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	47,924.55	91,956.12
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	306,700.05	334,620.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-19,697,572.94	-10,709,067.01
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-19,697,572.94	-10,709,067.01

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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）	122,892,000.00	-21,847,640.83	101,044,359.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-19,697,572.94	-19,697,572.94
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）	27,000,000.00	-8,309,342.91	18,690,657.09

其中：1. 基金申购款	63,000,000.00	-15,349,243.46	47,650,756.54
2. 基金赎回款	-36,000,000.00	7,039,900.55	-28,960,099.45
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）	149,892,000.00	-49,854,556.68	100,037,443.32
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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）	167,892,000.00	-9,083,512.67	158,808,487.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,709,067.01	-10,709,067.01
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）	-39,000,000.00	1,337,893.68	-37,662,106.32
其中：1. 基金申购款	33,000,000.00	-2,726,579.17	30,273,420.83
2. 基金赎回款	-72,000,000.00	4,064,472.85	-67,935,527.15
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）	128,892,000.00	-18,454,686.00	110,437,314.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

### 6.4.2 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。

### 6.4.3 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：

(a) 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的转让收入免征增值税，对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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(c) 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。

(d) 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。

(e) 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。

#### **6.4.4 关联方关系**

##### **6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司（“南方基金”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
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

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。

#### 6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.5.1.1 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 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 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	26,952,483.09	33.94	34,553,900.93	30.62

##### 6.4.5.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.5.1.3 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 6 月 30 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	2,690.09	33.90	2,384.70	55.20
关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 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	3,454.73	30.61	3,454.73	3.22

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。

#### 6.4.5.2 关联方报酬

##### 6.4.5.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	249,207.44	324,752.72
其中: 支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.50% 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 0.50% / 当年天数。

##### 6.4.5.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	49,841.48	64,950.50

注: 支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 X 0.10% / 当年天数。

##### 6.4.5.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未投资本基金。

##### 6.4.5.4.2 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

报告期末其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.5.5 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6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	2,355,815.60	7,991.20	1,920,892.63	7,475.37

注：本基金由基金托管人招商银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

#### 6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.6 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日 期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000022	深赤湾A	2017-11-20	重大资产重组	22.82	2018-07-10	20.55	2,800	59,357.49	63,896.00	-
000035	中国天楹	2017-08-22	重大资产重组	6.72	2018-07-09	6.05	18,500	136,936.94	124,320.00	-
000038	深大通	2018-02-26	重大事项	18.10	-	-	2,660	71,650.69	48,146.00	-
000048	*ST康达	2018-05-02	实行退市风险警示公告	21.90	2018-07-02	20.81	7,600	204,347.11	166,440.00	-
000545	金浦钛业	2018-06-11	重大资产重组	3.76	-	-	17,200	93,303.62	64,672.00	-

000584	哈工智能	2018-03-29	重大资产重组	13.87	2018-07-16	12.48	10,200	140,941.86	141,474.00	-
000603	盛达矿业	2018-06-11	拟筹划重大资产重组	10.83	-	-	8,700	124,767.56	94,221.00	-
000666	经纬纺机	2018-03-12	重大资产重组	18.08	-	-	3,900	80,216.76	70,512.00	-
000673	当代东方	2018-05-23	重大资产重组	18.34	2018-08-02	16.51	9,600	128,395.32	176,064.00	-
000711	京蓝科技	2018-03-26	重大事项	10.02	-	-	8,640	91,485.67	86,572.80	-
000796	凯撒旅游	2018-01-19	重大资产重组	12.90	2018-07-19	11.61	5,700	84,667.08	73,530.00	-
002053	云南能投	2018-05-28	重大资产重组	10.08	2018-07-13	9.07	5,500	64,641.39	55,440.00	-
002059	云南旅游	2018-03-26	重大资产重组	7.28	-	-	7,700	67,338.84	56,056.00	-
002086	东方海洋	2018-06-15	重大资产重组	6.68	-	-	11,000	114,762.26	73,480.00	-
002089	新海宜	2018-04-20	重大资产重组	6.05	2018-07-20	5.45	24,100	167,548.73	145,805.00	-
002102	冠福股份	2018-06-01	重大资产重组	4.07	-	-	51,600	245,890.13	210,012.00	-
002113	天润数娱	2018-02-01	重大事项	5.78	-	-	17,680	125,841.13	102,190.40	-
002121	科陆电子	2018-06-07	拟披露重大事项	6.49	2018-08-06	5.84	14,700	134,250.16	95,403.00	-
002171	楚江新材	2018-06-07	拟披露重大事项	6.78	-	-	11,000	85,127.86	74,580.00	-
002210	飞马国际	2018-03-26	拟披露重大事项	12.33	2018-08-13	11.07	16,170	188,764.10	199,376.10	-
002226	江南化工	2018-05-02	重大资产重组	5.42	-	-	9,600	70,796.37	52,032.00	-
002256	兆新股份	2018-03-02	重大事项	4.52	2018-07-02	4.07	18,700	118,427.13	84,524.00	-
002263	*ST东南	2018-02-26	重大资产重组	2.96	-	-	35,100	119,173.64	103,896.00	-
002301	齐心集团	2018-02-02	重大资产重组	10.50	2018-07-09	9.45	6,000	83,200.51	63,000.00	-
002436	兴森科技	2018-06-14	拟披露重大事项	4.29	-	-	29,600	184,238.50	126,984.00	-
002445	中南	2018-	重大资产	8.44	-	-	12,200	170,080.25	102,968.00	-



	文化	06-13	重组							
002464	众应 互联	2018- 02-02	重大资产 重组	21.19	2018- 07-31	19.07	4,760	122,043.44	100,864.40	-
002502	骅威 文化	2018- 06-05	重大资产 重组	5.82	-	-	11,300	105,291.10	65,766.00	-
002609	捷顺 科技	2018- 06-19	重大事项	9.52	2018- 07-03	8.57	8,200	121,759.45	78,064.00	-
002610	爱康 科技	2018- 06-05	重大事项	2.10	-	-	92,400	254,775.11	194,040.00	-
002611	东方 精工	2018- 06-19	拟披露重 大事项	6.17	2018- 07-03	6.01	14,400	124,289.60	88,848.00	-
002617	露笑 科技	2018- 05-09	重大资产 重组	8.15	-	-	13,350	137,763.68	108,802.50	-
002630	华西 能源	2018- 06-20	重大资产 重组	6.54	-	-	24,460	183,837.93	159,968.40	-
002650	加加 食品	2018- 03-12	重大资产 重组	4.86	-	-	17,000	122,398.22	82,620.00	-
002656	摩登 大道	2018- 06-19	拟披露重 大事项	9.61	-	-	6,920	93,514.38	66,501.20	-
002668	奥马 电器	2018- 06-15	拟披露重 大事项	20.10	-	-	9,680	218,013.11	194,568.00	-
002716	金贵 银业	2018- 05-03	重大资产 重组	16.84	-	-	8,100	165,039.13	136,404.00	-
002721	金一 文化	2018- 05-29	重大资产 重组	8.99	2018- 07-09	8.35	10,300	153,212.99	92,597.00	-
002872	天圣 制药	2018- 04-03	重大资产 重组	31.05	2018- 07-03	27.95	1,500	45,760.00	46,575.00	-
300008	天海 防务	2018- 06-19	重大事项	4.81	2018- 07-03	5.20	15,150	114,976.90	72,871.50	-
300090	盛运 环保	2018- 06-04	拟披露重 大事项	8.32	2018- 07-02	7.49	23,600	246,485.22	196,352.00	-
300118	东方 日升	2018- 05-07	重大资产 重组	10.80	2018- 08-07	9.63	11,000	149,449.49	118,800.00	-
300131	英唐 智控	2018- 05-29	重大资产 重组	5.67	-	-	13,500	113,990.76	76,545.00	-
300198	纳川 股份	2018- 02-02	重大资产 重组	5.99	2018- 08-02	5.38	14,600	98,737.28	87,454.00	-
300229	拓尔 思	2018- 04-17	重大资产 重组	15.88	2018- 07-17	14.29	4,700	76,101.47	74,636.00	-
300238	冠昊 生物	2018- 02-02	重大资产 重组	18.87	2018- 07-18	16.98	5,100	173,615.79	96,237.00	-
300299	富春 股份	2018- 06-19	拟披露重 大事项	4.67	2018- 07-17	5.14	10,295	87,091.30	48,077.65	-

300317	珈伟股份	2018-02-05	重大资产重组	11.90	2018-07-03	10.71	7,993	152,116.01	95,116.70	-
300343	联创互联	2018-06-19	拟披露重大事项	10.00	-	-	7,700	122,738.13	77,000.00	-
300350	华鹏飞	2018-05-10	重大资产重组	8.13	2018-07-16	7.32	5,080	52,963.51	41,300.40	-
300362	天翔环境	2018-06-08	重大资产重组	9.68	-	-	4,700	68,498.77	45,496.00	-
600146	商赢环球	2018-06-19	重大资产重组	22.22	2018-08-15	20.00	5,900	145,181.00	131,098.00	-
600165	新日恒力	2018-02-13	重大事项	16.51	2018-07-05	14.86	10,000	141,839.76	165,100.00	-
600175	美都能源	2018-05-30	拟筹划重大资产重组	4.16	2018-08-17	3.74	51,700	260,435.39	215,072.00	-
600217	中再资环	2018-03-29	重大资产重组	6.13	-	-	17,300	120,228.24	106,049.00	-
600226	瀚叶股份	2017-11-28	重大资产重组	4.56	-	-	30,394	164,802.64	138,596.64	-
600318	新力金融	2018-03-23	重大资产重组	11.04	-	-	9,000	123,040.74	99,360.00	-
600399	抚顺特钢	2018-01-31	未及时披露定期报告	5.50	-	-	20,900	135,191.72	114,950.00	-
600490	鹏欣资源	2018-04-16	重大资产重组	8.67	-	-	32,600	275,146.22	282,642.00	-
600641	万业企业	2018-04-17	拟筹划重大资产重组	12.18	2018-08-09	10.96	9,900	125,432.70	120,582.00	-
600764	中电广通	2018-04-16	拟筹划重大资产重组	31.77	-	-	3,800	116,109.64	120,726.00	-
600784	鲁银投资	2018-01-11	重大资产重组	5.46	2018-07-09	5.24	10,000	77,333.00	54,600.00	-
600800	天津磁卡	2018-05-21	拟筹划重大资产重组	5.47	-	-	12,900	97,108.41	70,563.00	-
603299	井神股份	2018-06-28	重要事项未公告	8.25	2018-07-05	8.48	7,400	87,579.21	61,050.00	-
603636	南威软件	2018-05-29	拟筹划重大资产重组	10.00	-	-	6,699	86,577.05	66,990.00	-
603939	益丰	2018-	拟筹划重	59.72	2018-	65.69	3,700	155,606.44	220,964.00	-

	药房	04-17	大资产重组		07-16					
603997	继峰股份	2018-05-30	拟筹划重大资产重组	10.87	-	-	4,500	57,782.38	48,915.00	-
600745	闻泰科技	2018-04-17	重大资产重组	30.48	-	-	8,300	218,724.01	252,984.00	-
000967	盈峰环境	2018-05-18	重大事项	8.70	2018-07-31	8.01	11,990.00	110,970.95	104,313.00	-
002239	奥特佳	2018-04-02	重大事项	3.62	-	-	22,480.00	104,431.11	81,377.60	-

注：本基金截至 2018 年 6 月 30 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。

#### 6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	97,204,649.75	96.62
	其中：股票	97,204,649.75	96.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,679.22	0.00
	其中：债券	2,679.22	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,980,388.12	2.96
8	其他各项资产	413,600.59	0.41
9	合计	100,601,317.68	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	888,178.80	0.89

B	采矿业	2,269,020.16	2.27
C	制造业	61,854,308.06	61.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,320,267.63	2.32
E	建筑业	2,650,406.33	2.65
F	批发和零售业	4,139,456.26	4.14
G	交通运输、仓储和邮政业	2,277,029.60	2.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,885,129.24	9.88
J	金融业	388,415.00	0.39
K	房地产业	3,155,701.94	3.15
L	租赁和商务服务业	1,228,687.64	1.23
M	科学研究和技术服务业	985,433.90	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	1,116,857.00	1.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	963,711.00	0.96
R	文化、体育和娱乐业	1,676,691.14	1.68
S	综合	807,387.00	0.81
	合计	96,606,680.70	96.57

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	513,276.96	0.51
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	85,818.69	0.09
	合计	599,095.65	0.60

### 7.2.3 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股票投资。

## 7.3 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

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300142	沃森生物	33,500	669,330.00	0.67
2	600779	水井坊	9,200	508,116.00	0.51
3	300347	泰格医药	8,200	507,334.00	0.51
4	300601	康泰生物	6,840	424,422.00	0.42
5	300168	万达信息	19,600	399,840.00	0.40
6	300176	鸿特科技	4,400	364,892.00	0.36
7	600567	山鹰纸业	87,100	336,206.00	0.34
8	002821	凯莱英	3,800	331,474.00	0.33
9	002507	涪陵榨菜	12,800	328,704.00	0.33
10	000735	罗牛山	25,100	324,292.00	0.32

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.nffund.com> 的年度报告正文。

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000048	*ST 康达	7,600	166,440.00	0.17
2	600399	抚顺特钢	20,900	114,950.00	0.11

3	002263	*ST 东南	35,100	103,896.00	0.10
4	300747	锐科激光	1,286	103,342.96	0.10
5	600784	鲁银投资	10,000	54,600.00	0.05
6	000409	*ST 地矿	9,547	31,218.69	0.03
7	002260	*ST 德奥	5,200	24,648.00	0.02

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	300601	康泰生物	346,234.00	0.34
2	300176	鸿特科技	344,395.00	0.34
3	300142	沃森生物	339,242.00	0.34
4	002507	涪陵榨菜	287,396.00	0.28
5	601699	潞安环能	286,305.00	0.28
6	002821	凯莱英	250,094.00	0.25
7	300558	贝达药业	230,696.00	0.23
8	000697	炼石有色	215,354.00	0.21
9	300347	泰格医药	208,954.00	0.21
10	002727	一心堂	207,786.00	0.21
11	002035	华帝股份	185,645.00	0.18
12	000799	酒鬼酒	175,180.00	0.17
13	000710	贝瑞基因	171,847.00	0.17
14	000507	珠海港	169,577.00	0.17
15	300168	万达信息	167,964.00	0.17
16	000735	罗牛山	167,616.00	0.17
17	603399	新华龙	161,017.00	0.16
18	600200	江苏吴中	160,068.00	0.16
19	002292	奥飞娱乐	159,773.00	0.16
20	300355	蒙草生态	155,357.00	0.15

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。

### 7.4.2 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	300418	昆仑万维	336,090.00	0.33
2	002600	领益智造	318,372.00	0.32

3	300308	中际旭创	277,603.00	0.27
4	603885	吉祥航空	242,015.00	0.24
5	002925	盈趣科技	220,131.02	0.22
6	000735	罗牛山	211,241.00	0.21
7	002920	德赛西威	197,866.95	0.20
8	000518	四环生物	183,838.00	0.18
9	300454	深信服	183,812.04	0.18
10	002509	天广中茂	180,441.00	0.18
11	000980	众泰汽车	179,972.00	0.18
12	002625	光启技术	178,508.30	0.18
13	002302	西部建设	174,789.00	0.17
14	002916	深南电路	169,842.88	0.17
15	002926	华西证券	164,072.12	0.16
16	002647	仁东控股	155,078.75	0.15
17	000553	沙隆达 A	153,290.00	0.15
18	300142	沃森生物	146,929.00	0.15
19	300741	华宝股份	146,899.35	0.15
20	300347	泰格医药	145,469.00	0.14

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。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	47,354,192.19
卖出股票收入(成交)总额	32,799,400.13

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。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	2,679.22	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	2,679.22	0.00
----	----	----------	------

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128023	亚太转债	9	783.45	0.00
2	128019	久立转 2	6	551.10	0.00
3	128037	岩土转债	5	433.25	0.00
4	128018	时达转债	4	347.08	0.00
5	123007	道氏转债	3	305.40	0.00

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1812	IC1812	2	2,003,360.00	-178,640.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-178,640.00
股指期货投资本期收益（元）					-152,520.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-216,880.00

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。



## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 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	412,870.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	729.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	413,600.59

### 7.12.4 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	占基金资产净值比例 (%)
1	128018	时达转债	347.08	0.00
2	128019	久立转 2	551.10	0.00
3	128023	亚太转债	783.45	0.00

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	公司名称	流通受限部分的公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000048	*ST 康达	166,440.00	0.17	重大事项

2	600399	抚顺特钢	114,950.00	0.11	重大事项
3	002263	*ST 东南	103,896.00	0.10	重大事项
4	600784	鲁银投资	54,600.00	0.05	重大事项

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
3,339	44,891.28	3,317,400.00	2.21	146,574,600.00	97.79	-	-

注：户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	颜飞	6,246,100.00	4.17
2	张改花	4,000,000.00	2.67
3	李洪琴	3,780,000.00	2.52
4	方正证券股份有限公司	3,047,100.00	2.03
5	王思宇	2,500,000.00	1.67
6	杨海锋	2,100,000.00	1.40
7	张永劭	2,006,000.00	1.34
8	陶冶	2,000,000.00	1.33
9	张瑞华	1,861,300.00	1.24
10	王磊	1,600,000.00	1.07

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、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。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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。

。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	122,892,000.00
本报告期基金总申购份额	63,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	36,000,000.00
本报告期期末基金份额总额	149,892,000.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
万联证券	1	50,870,241.16	64.06%	5,087.65	64.12%	
华泰证券	4	26,952,48	33.94%	2,690.09	33.90%	

		3.09				
国信证券	1	1,587,550.53	2.00%	157.43	1.98%	
银河证券	1	-	-	-	-	
华创证券	1	-	-	-	-	

注：交易单元的选择标准和程序 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

#### A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	37,139.20	29.15%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	90,255.14	70.85%	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注:无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。