

南方安福混合型证券投资基金 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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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 6 月 30 日止。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方安福混合
基金主代码	005059
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 11 月 2 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	126,230,983.17 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“南方安福”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具,辅助投资于精选的股票,通过灵活的资产配置与严谨的风险管理,力求实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	本基金通过灵活的资产配置与严谨的风险管理,力求实现基金资产持续稳定增值,实际投资过程中,将“优化的 CPPI 策略”作为大类资产配置的主要出发点,主要投资于债券等固定收益类金融工具,辅助投资于精选的股票。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15%+上证国债指数收益率×85%
风险收益特征	本基金为债券投资为主的混合型基金,属于中低风险、中低收益预期的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95528
传真	0755-82763889	021-63602540

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

§ 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	1,454,352.29
本期利润	520,420.46
加权平均基金份额本期利润	0.0031
本期基金份额净值增长率	0.03%
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	0.0042
期末基金资产净值	126,755,719.38
期末基金份额净值	1.0042

注:1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.92%	0.21%	-0.79%	0.19%	-0.13%	0.02%
过去三个月	-0.23%	0.17%	-0.23%	0.17%	0.00%	0.00%
过去六个月	0.03%	0.14%	0.43%	0.18%	-0.40%	-0.04%
自基金合同生效起至今	0.42%	0.12%	0.59%	0.17%	-0.17%	-0.05%

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

南方安福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：截至本报告期末，本基金成立不满一年。本基金的建仓期为 6 个月，报告期末建仓期已结束且各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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	
吴剑毅	本基金基金经理	2017 年 11 月 2 日	-	9 清华大学金融学硕士，具有基金从业资格。2009 年 7 月加入南方基金，任南方基金研究部金融行业研究员；2012 年 3 月至 2014 年 7 月，担任南方避险、南方保本基金经理助理；2015 年 11 月至 2017 年 12 月，任南方顺康保本基金经理；2014 年 7 月至 2018 年 1 月，任南方恒元基金经理；2015 年 5 月至今，任南方利众基金经理；2015 年 7 月至今，任南方利达基金经理；2015 年 9 月至今，任南方消费活力基金经理；2015 年 10 月至今，任南方顺达基金经理；2015 年 11 月至今，任南方利安基金经理；2016 年 12 月至今，任南方安颐混合基金经理；2017 年 8 月至今，任南方金融混合基金经理；2017 年 11 月至今，任南方安福混合基金经理；2017 年 12 月至今，任南方顺康混合基金经理；2018 年 2 月至今，任南方安养混合基金经理。

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《南方安福混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，并且交易占优比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合

或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 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

2018 年上半年，国民经济延续总体平稳、稳中向好的发展态势。GDP 同比增长 6.8%，规模以上工业增加值均同比增长 6.7%，社会消费品零售总额同比增长 9.4%，CPI 同比上涨 2%。数据显示通胀温和可控，消费对经济增长的基础性作用进一步增强。报告期中美贸易战持续升温，在历经多轮回击对峙、谈判磋商后，一度以和平方式得以缓和，但随后美方单方面撕毁谈判结果，再度宣布惩罚性关税清单，中美贸易摩擦急剧升级。股票市场方面，在中美贸易摩擦加剧、债券违约事件频发以及股权质押风险暴露等多因素影响下，市场在 1 月短暂上扬后，步入单边下跌行情，报告期内上证综指下跌 13.9%，创业板指下跌 8.33%，沪深 300 指数下跌 12.9%。结构上延续了 17 年以来的分化行情，一季度创业板、军工、计算机、传媒等板块触底反弹，大幅跑赢市场，而食品饮料、家用电器、金融、周期品等 17 年表现优异的板块高位回落，表现欠佳；二季度随着市场整体下跌，食品饮料、医药、家电等业绩确定性高、现金流较好的消费品体现了较好的防御性。债券市场方面，贸易战和对经济的负面预期带动避险情绪上升，而央行先后公告降准、定向降准，货币政策转向中性偏松，导致资金面超预期宽松。多种因素共同作用下利率债曲线持续下行，而中低评级信用债受融资渠道收紧影响信用利差显著上行。报告期中证全债指数上涨 4.35%。报告期内，我们在市场下跌过程中适度提升了股票仓位，重点在低估值或者估值相比国际水平有提升空间的板块中选择优质个股。固定收益投资方面，我们在年初拉长了组合久期，而随着长端利率债收益率的大幅下行，我们对当前长债持相对谨慎态度，在 6 月份适度降低了组合久期，组合整体固收资产配置以获取持有到期收益为主。

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 1.0042 元，本报告期份额净值增长率为 0.03%，同期业绩比较基准增长率为 0.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为当前市场处于底部区域，机会远大于风险。一方面，沪深 300 估值仅为 12 倍左右，处于历史中低水平，市场整体估值及杠杆水平均较为健康。另一方面，资管新规打破了银行理财的刚性兑付，使得无风险利率趋势性下行，大幅提升了低估值、高股息的股票的

配置价值。中长期看，随着沪港通、MSCI 和养老金的逐步进场，A 股仍有源源不断的增量资金。随着去杠杆、贸易战等负面预期出现好转，下半年市场有望迎来较大幅度的反弹。在系统性风险不大的前提下，我们认为市场的结构性行情仍将持续，因此，配置上我们重点考虑两个方面的思路。一是绝对估值低、分红率高的板块，典型代表有银行和钢铁。它们的 PE 多数在 6 倍以下，对应的股息收益率在 5%以上，随着无风险利率的下降，将不断成为资金追逐的方向。二是相对国际市场，估值水平低或者稀缺的板块，代表有家电和白酒。随着沪港通、MSCI 资金的流入，A 股原本相对封闭的估值体系被打破，逐步融入国际市场中的一员，投资者结构逐步成熟，估值水平相对国际偏低的板块将继续获得估值提升的机会。固定收益方面，我们认为当前的收益率水平已经隐含了较为乐观的预期，因此对组合的久期和杠杆都选择相对谨慎的操作，主要持有高评级的信用债或存单，组合的平均久期保持在 1 年左右，以获取确定性的持有到期收益为主。

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

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，若本基金份额净值连续 10 个工作日不低于 1.15 元，且第 10 个工作日的基金可供分配利润大于零时，则本基金将以该日为基金收益分配基准日进行收益分配，但本基金两次收益分配基准日间的间隔不得低于 30 个工作日，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 90%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净

值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。同一类别每一基金份额享有同等分配权，法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对南方安福混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《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、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对南方安福混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由南方基金管理股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：南方安福混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款		2,155,103.02	24,048,434.75
结算备付金		639,592.18	737,418.59
存出保证金		27,129.90	6,498.61
交易性金融资产		146,619,932.80	139,981,214.70
其中：股票投资		21,633,172.00	6,657,064.00
基金投资		-	-
债券投资		124,986,760.80	133,324,150.70
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		-	56,000,000.00
应收证券清算款		59,738.22	10,099.73
应收利息		2,548,932.66	1,192,564.61
应收股利		-	-
应收申购款		296.44	969.26
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		152,050,725.22	221,977,200.25
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末
		2018年6月30日	2017年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		24,000,000.00	-
应付证券清算款		503,201.70	108,736.66
应付赎回款		427,658.18	379,997.89
应付管理人报酬		107,886.96	199,333.01
应付托管费		21,577.37	39,866.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		27,585.23	10,866.01
应交税费		2,741.42	-
应付利息		21,895.90	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		182,459.08	477.31
负债合计		25,295,005.84	739,277.49
所有者权益：			
实收基金		126,230,983.17	220,385,536.42
未分配利润		524,736.21	852,386.34
所有者权益合计		126,755,719.38	221,237,922.76
负债和所有者权益总计		152,050,725.22	221,977,200.25

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，南方安福份额净值 1.0042 元，份额为 126,230,983.17 份。

6.2 利润表

会计主体：南方安福混合型证券投资基金

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	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		2,015,573.70
1. 利息收入		3,319,646.63
其中：存款利息收入		128,274.54
债券利息收入		2,910,288.47
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		281,083.62
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-595,192.23
其中：股票投资收益		-850,876.43
基金投资收益		-
债券投资收益		-42,388.16
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		298,072.36
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-933,931.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		225,051.13
减：二、费用		1,495,153.24
1. 管理人报酬		847,598.19
2. 托管费		169,519.57
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		118,061.92
5. 利息支出		163,448.94
其中：卖出回购金融资产支出		163,448.94
6. 税金及附加		2,580.69
7. 其他费用		193,943.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		520,420.46
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		520,420.46

注：南方安福于 2017 年 11 月 2 日成立，故无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方安福混合型证券投资基金

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)	220,385,536.42	852,386.34	221,237,922.76
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	520,420.46	520,420.46
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)	-94,154,553.25	-848,070.59	-95,002,623.84
其中：1. 基金申购款	1,542,334.14	11,733.49	1,554,067.63
2. 基金赎回款	-95,696,887.39	-859,804.08	-96,556,691.47
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)	126,230,983.17	524,736.21	126,755,719.38

注：南方安福于 2017 年 11 月 2 日成立，故无上年度可比期间数据。

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 基金基本情况

南方安福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[2017]507 号《关于准予南方安福混合型证券投资基金注册的批复》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《南方安福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 271,082,520.63 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 981 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方安福混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 11 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 271,154,512.62 份基金份额，其中认购资金利息折合 71,991.99 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方安福混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、权证、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0-30%；债券等固定收益类金融工具投资占基金资产的比例不低于 70%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×15%+上证国债指数收益率×85%。

6.4.2 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》、《南方安福混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日和 2017 年 11 月 2 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 2018 年 6 月 30 日和 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日和 2017 年 11 月 2 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。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日和 2017 年 11 月 2 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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公允价值变动计入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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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》、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、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。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、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。

(c) 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。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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、登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	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（“兴业证券”）	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	84,366,896.93	100.00

6.4.8.1.2 债券交易

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	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)

华泰证券	34,615,447.11	100.00
------	---------------	--------

6.4.8.1.3 债券回购交易

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	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
华泰证券	702,900,000.00	100.00

6.4.8.1.4 权证交易

注：无。

6.4.8.1.5 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	76,878.36	100.00	27,410.23	100.00

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，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后的净额列示。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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	847,598.19
其中：支付销售机构的客户维护费	291,104.66

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 1.00% 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 1.00% / 当年天数。

6.4.8.2.2 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	
当期发生的基金应支付的托管费	169,519.57	

注：支付基金托管人上海浦东发展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 × 0.20% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	2,155,103.02	118,907.41

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2018 年 06 月 30 日)本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无。

6.4.9.2 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
002171	楚江新材	2018-06-07	拟披露重大事项	6.78	-	-	25,000	174,802.44	169,500.00	-
603456	九洲药业	2018-06-05	重大资产重组	9.60	2018-7-5	8.64	9,000	83,617.00	86,400.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 24,000,000.00 元, 于 2018 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

§ 7 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	21,633,172.00	14.23
	其中：股票	21,633,172.00	14.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	124,986,760.80	82.20
	其中：债券	124,986,760.80	82.20
	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	2,794,695.20	1.84

8	其他各项资产	2,636,097.22	1.73
9	合计	152,050,725.22	100.00

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	122,590.00	0.10
B	采矿业	682,952.00	0.54
C	制造业	9,458,009.40	7.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	733,607.00	0.58
F	批发和零售业	1,283,641.20	1.01
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	498,883.00	0.39
J	金融业	8,280,687.00	6.53
K	房地产业	156,160.00	0.12
L	租赁和商务服务业	416,642.40	0.33
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	21,633,172.00	17.07

7.2.2 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。

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

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	601288	农业银行	663,600	2,282,784.00	1.80
2	601398	工商银行	365,300	1,943,396.00	1.53
3	601166	兴业银行	126,400	1,820,160.00	1.44
4	000786	北新建材	33,700	624,461.00	0.49

5	000333	美的集团	11,600	605,752.00	0.48
6	600926	杭州银行	47,200	523,448.00	0.41
7	600597	光明乳业	50,600	499,422.00	0.39
8	600030	中信证券	29,500	488,815.00	0.39
9	600066	宇通客车	23,300	447,127.00	0.35
10	601318	中国平安	7,400	433,492.00	0.34

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	601288	农业银行	2,584,412.00	1.17
2	601166	兴业银行	2,144,189.00	0.97
3	601398	工商银行	2,099,593.00	0.95
4	601998	中信银行	1,205,411.80	0.54
5	600016	民生银行	1,017,861.00	0.46
6	601229	上海银行	996,496.00	0.45
7	601668	中国建筑	880,796.00	0.40
8	000932	华菱钢铁	765,227.00	0.35
9	000786	北新建材	696,367.00	0.31
10	600068	葛洲坝	665,691.00	0.30
11	000333	美的集团	648,063.06	0.29
12	600597	光明乳业	640,371.00	0.29
13	600837	海通证券	626,502.00	0.28
14	000717	韶钢松山	594,849.00	0.27
15	600808	马钢股份	594,819.00	0.27
16	600926	杭州银行	594,073.00	0.27
17	600030	中信证券	580,608.00	0.26
18	600858	银座股份	481,953.00	0.22
19	002555	三七互娱	462,741.28	0.21
20	600176	中国巨石	447,174.00	0.20

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	601998	中信银行	1,186,498.00	0.54

2	601229	上海银行	967,542.84	0.44
3	000932	华菱钢铁	862,291.00	0.39
4	600016	民生银行	820,744.00	0.37
5	601668	中国建筑	773,869.00	0.35
6	600068	葛洲坝	622,009.65	0.28
7	600837	海通证券	545,664.00	0.25
8	000717	韶钢松山	479,996.00	0.22
9	601003	柳钢股份	419,357.71	0.19
10	603609	禾丰牧业	395,117.00	0.18
11	002612	朗姿股份	394,998.00	0.18
12	600690	青岛海尔	383,785.00	0.17
13	600900	长江电力	376,638.00	0.17
14	601328	交通银行	375,378.00	0.17
15	000786	北新建材	365,639.00	0.17
16	601009	南京银行	341,448.00	0.15
17	600019	宝钢股份	329,544.00	0.15
18	002304	洋河股份	325,198.07	0.15
19	300367	东方网力	305,185.00	0.14
20	300072	三聚环保	282,996.00	0.13

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	51,141,415.03
卖出股票收入(成交)总额	33,309,136.90

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	24,806,000.00	19.57
	其中:政策性金融债	9,990,000.00	7.88
4	企业债券	42,388,000.00	33.44
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	211,760.80	0.17
8	同业存单	57,581,000.00	45.43

9	其他	-	-
10	合计	124,986,760.80	98.60

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	150317	15 进出 17	100,000	9,990,000.00	7.88
2	111821062	18 渤海银行 CD062	100,000	9,778,000.00	7.71
3	111893751	18 徽商银行 CD052	100,000	9,566,000.00	7.55
4	111715473	17 民生银行 CD473	100,000	9,565,000.00	7.55
5	111718483	17 华夏银行 CD483	100,000	9,565,000.00	7.55

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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 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。

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除恒丰银行股份有限公司以外，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。2017 年 12 月 29 日，中国银监会对恒丰银行股份有限公司违规员工持股、高管薪酬未披露、违规对非保本浮动收益理财产品出具担保函等多项违规行为进行处罚，没收违法所得 7566.106815 万元，并处 1 倍罚款 7566.106815 万元，对其他违规行为罚款 1560 万元，罚没合计 16692.21363 万元。基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	27,129.90
2	应收证券清算款	59,738.22
3	应收股利	-
4	应收利息	2,548,932.66
5	应收申购款	296.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,636,097.22

7.12.4 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。

7.12.5 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。

§ 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 (%)
2,625	48,087.99	-	-	126,230,983.17	100.00

8.2 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	58,724.93	0.0465

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 11 月 2 日）	
基金份额总额	271,154,512.62
本报告期期初基金份额总额	220,385,536.42
本报告期基金总申购份额	1,542,334.14
减：本报告期基金总赎回份额	95,696,887.39
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	126,230,983.17

§ 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，基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）根据工作需要，任命孔建先生担任公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。孔建先生的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。

本报告期内，基金管理人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

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

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	

华泰证券	2	84,366,896.93	100.00%	76,878.36	100.00%	-
------	---	---------------	---------	-----------	---------	---

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
华泰证券	34,615,447.11	100.00%	702,900,000.00	100.00%	-	-