

# 南方安心保本混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

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。

## 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>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 6         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 8         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 9         |
| 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             | 9         |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 10        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 10        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 10        |
| 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       | 10        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>11</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 11        |
| 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 | 11        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见      | 11        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>11</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 11        |
| 6.2 利润表                                 | 12        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 13        |
| 6.4 报表附注                                | 14        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>32</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 32        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 33        |
| 7.3 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       | 33        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 35        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 37        |
| 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      | 37        |
| 7.7 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    | 37        |

|  |           |
|--|-----------|
| 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..... | 37        |
| 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.....    | 38        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 38        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 38        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 38        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>                  | <b>39</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 39        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 39        |
| 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.....      | 39        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>                  | <b>40</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示.....</b>                    | <b>40</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 40        |
| 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.....      | 40        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 40        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 40        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 40        |
| 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.....         | 40        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 40        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 42        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>            | <b>43</b> |
| 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.....    | 43        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                   | 43        |
| <b>§ 12 备查文件目录.....</b>                    | <b>43</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                           | 43        |
| 12.2 存放地点.....                             | 43        |
| 12.3 查阅方式.....                             | 43        |

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 南方安心保本混合型证券投资基金    |
| 基金简称       | 南方安心保本混合           |
| 基金主代码      | 202213             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2012 年 12 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      | 招商银行股份有限公司         |
| 报告期末基金份额总额 | 2,931,537,986.89 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“南方安心”。

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金在保障保本周期到期时本金安全的前提下,有效控制风险,追求基金资产的稳定增值。   |
| 投资策略   | 本基金按照时间不变性投资组合保险(TIPP, Time Invariant Portfolio Protection)策略进行资产配置,以实现保本和增值的目标。TIPP 策略设置了一条保本投资底线,该底线随着投资组合收益的增加而调整。TIPP 策略改进了 CPPI 中保本投资底线的调整方式,每当收益率达到一定的比率并持续一段时间后,保本投资底线相应提高一定比例,以锁定一部分前期投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 三年期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。   |

### 2.3 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                      |
|         | 联系电话                           | 0755-82763888            |
|         | 电子邮箱                           | manager@southernfund.com |
| 客户服务电话  | 400-889-8899                   | 95555                    |
| 传真      | 0755-82763889                  | 0755-83195201            |
| 注册地址    | 深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层 | 中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦    |
| 办公地址    | 深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层 | 中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦    |
| 邮政编码    | 518048                         | 518040                   |
| 法定代表人   | 张海波                            | 李建红                      |

## 2.4 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 | 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  | 重庆三峡担保集团股份有限公司 | 重庆市渝中区中华路 178 号国际商务中心 6 楼      |

## § 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       | 46,410,926.57                |
| 本期利润          | 36,034,275.75                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0120                       |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.15%                        |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.17%                        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年06月30日)            |
| 期末可供分配利润      | 255,894,181.85               |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0873                       |
| 期末基金资产净值      | 3,051,471,991.86             |
| 期末基金份额净值      | 1.041                        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2018年06月30日)            |
| 基金份额累计净值增长率   | 61.15%                       |

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

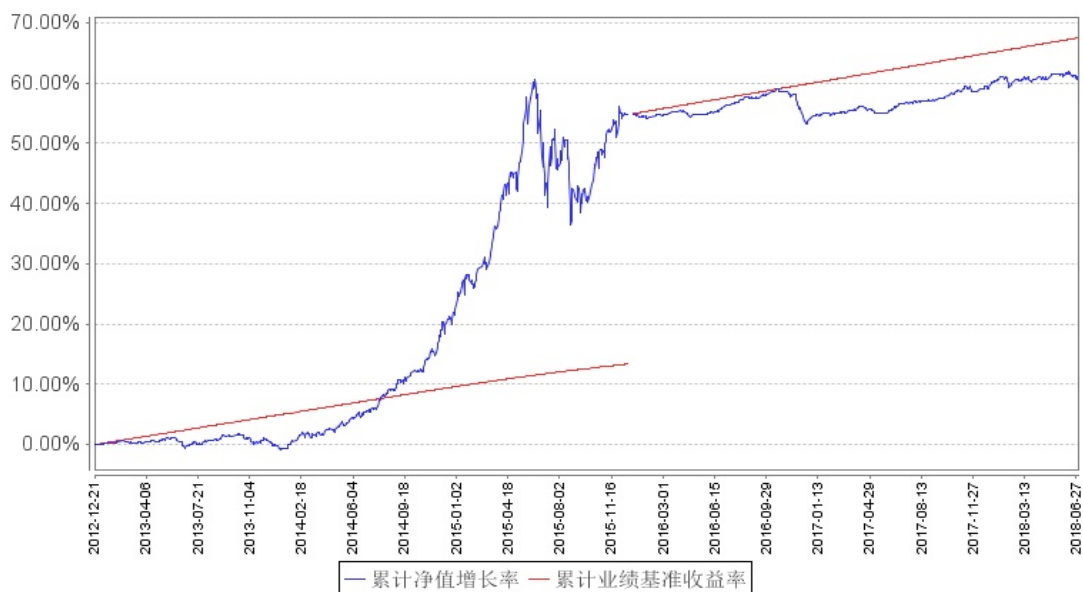
| 阶段 | 份额净值 | 份额净值 | 业绩比较基 | 业绩比较基准 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|-------|--------|-----|-----|
|----|------|------|-------|--------|-----|-----|

|                | 增长率①   | 增长率标准<br>差② | 准收益率③  | 收益率标准<br>差④ |         |        |
|----------------|--------|-------------|--------|-------------|---------|--------|
| 过去一个月          | -0.19% | 0.13%       | 0.25%  | 0.01%       | -0.44%  | 0.12%  |
| 过去三个月          | 0.39%  | 0.11%       | 0.75%  | 0.01%       | -0.36%  | 0.10%  |
| 过去六个月          | 1.17%  | 0.13%       | 1.51%  | 0.01%       | -0.34%  | 0.12%  |
| 过去一年           | 2.97%  | 0.11%       | 3.10%  | 0.01%       | -0.13%  | 0.10%  |
| 过去三年           | 7.43%  | 0.44%       | 49.94% | 1.35%       | -42.51% | -0.91% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 61.15% | 0.45%       | 67.52% | 1.00%       | -6.37%  | -0.55% |

注:根据《南方安心保本混合型证券投资基金基金合同》以及《南方安心保本混合型证券投资基金保本到期操作规则及转入下一保本期的相关规则的提示性公告》的相关规定,本基金的第一个保本期为三年,自2012年12月21日至2015年12月21日止;第二个保本期为三年,自2015年12月29日至2018年12月29日止。

### 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

南方安心保本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



## § 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 |        |   |
| 卢玉珊 | 本基金基金经理 | 2015 年 12 月 30 日 | -    | 9      | 女，清华大学会计学硕士，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，负责纺织服装、商贸零售的行业研究工作；2015 年 2 月至 2015 年 12 月，任南方成份、南方安心的基金经理助理；2015 年 5 月至 2015 年 12 月，任南方改革机遇的基金经理助理；2015 年 12 月至今，任南方安心基金经理。 |

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《南方安心保本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。

#### 4.3.2 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

回顾上半年，受中美贸易战、去杠杆持续推进和棚改货币化政策变化等内外宏观环境变化的影响，整个市场跌幅较大。wind全A下跌14.65%，其中上证50和沪深300分别下跌13.3%和12.9%，创业板下跌8.33%。分行业看，由于业绩表现较好，与宏观相关度不高，医药食品饮料分别上涨4.46%和1.82%，体现了良好的防御属性。通信传媒电新等行业受市场风险偏好降低等原因影响跌幅较大。稳健资产方面，资金面较为宽松，债券市场收益率有较明显的下行。安心将于年底到期，受避险基金规定稳健资产不能低于80%占比的限制，无法配置久期偏长的债券。我们将到期债券转换为高收益的存单和短融，主要获得稳定的利息收入。上半年我们权益部分仓位没有超过8个点，18年是安心保本期的最后一年，我们会择机提高权益部分的仓位，增强组合的进攻性。在投资框架上，我们希望能够坚持低PE高ROE的选股策略，在低估值的基础上，选择ROE较高，尤其是趋势向上的公司。在行业配置上，主要仓位还是配置在了银行、食品饮料、家电以及与经济关联度较弱的消费品龙头的配置，增配了部分估值和业绩增速匹配度较好的成长股。在个股的选择上，我们仍然坚持细分行业龙头，尤其是那些规模与盈利能力与第二名的优势在持续扩大的龙头。

#### 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 1.041 元，本报告期份额净值增长率为 1.17%，同期业绩比较基准增长率为 1.51%。

#### 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，资管新规落地缓解了前期市场过度悲观的预期，在系统性风险下降的背景下，会涌现出更多的投资机会。但另一方面，由于政策只是更加强调把控节奏力度，并非大规模转向，叠加外部不确定性仍有待消除，投资上我们也会更多地关注创新带来的投资机会。

#### 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，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；保本周期内，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“南方核心竞争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；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，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遵规守信、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：南方安心保本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<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 2,395,964.66           | 16,163,983.65            |
| 结算备付金      |         | 3,388,542.78           | 9,912,181.48             |
| 存出保证金      |         | 134,123.05             | 203,639.13               |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 2,975,695,023.80       | 3,287,752,555.33         |
| 其中：股票投资    |         | 216,125,573.80         | 272,061,923.13           |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | 2,759,569,450.00       | 3,015,690,632.20         |
| 资产支持证券投资   |         | -                      | -                        |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 贵金属投资           |            | -                         | -                           |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 20,000,000.00             | 20,000,000.00               |
| 应收证券清算款         |            | 18,281,006.03             | 10,104,268.67               |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 64,188,197.48             | 50,096,475.20               |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | -                         | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 3,084,082,857.80          | 3,394,233,103.46            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>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          | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | 28,000,000.00             | 167,000,000.00              |
| 应付证券清算款         |            | -                         | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                         | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 3,400,385.76              | 3,724,452.82                |
| 应付托管费           |            | 503,760.85                | 551,770.80                  |
| 应付销售服务费         |            | -                         | -                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 370,288.73                | 732,024.89                  |
| 应交税费            |            | 137,082.63                | -                           |
| 应付利息            |            | -                         | 242,682.16                  |
| 应付利润            |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                         | -                           |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 199,347.97                | 397,000.00                  |
| 负债合计            |            | 32,610,865.94             | 172,647,930.67              |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 2,795,577,810.01          | 2,984,850,514.97            |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 255,894,181.85            | 236,734,657.82              |
| 所有者权益合计         |            | 3,051,471,991.86          | 3,221,585,172.79            |
| 负债和所有者权益总计      |            | 3,084,082,857.80          | 3,394,233,103.46            |

注: 报告截止日 2018 年 6 月 30 日, 基金份额净值 1.041 元, 基金份额总额 2,931,537,986.89 份。

## 6.2 利润表

会计主体: 南方安心保本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 | 上年度可比期间 |
|----|-----|----|---------|
|----|-----|----|---------|

|                        |            | 2018年1月1日至<br>2018年6月30日 | 2017年1月1日至<br>2017年6月30日 |
|------------------------|------------|--------------------------|--------------------------|
| 一、收入                   |            | 63,804,574.63            | 92,582,233.80            |
| 1. 利息收入                |            | 62,874,094.83            | 79,927,684.62            |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 102,178.33               | 13,318,982.29            |
| 债券利息收入                 |            | 62,438,031.77            | 62,249,932.86            |
| 资产支持证券利息收入             |            | -                        | -                        |
| 买入返售金融资产收入             |            | 333,884.73               | 4,358,769.47             |
| 其他利息收入                 |            | -                        | -                        |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 10,464,429.58            | -13,180,481.85           |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | 12,206,722.67            | 15,020,357.39            |
| 基金投资收益                 |            | -                        | -                        |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | -4,462,496.93            | -29,766,831.23           |
| 资产支持证券投资收益             | 6.4.7.13.5 | -                        | -                        |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.14   | -                        | -                        |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.15   | -                        | -                        |
| 股利收益                   | 6.4.7.16   | 2,720,203.84             | 1,565,991.99             |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.17   | -10,376,650.82           | 24,491,567.22            |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)     |            | -                        | -                        |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列)     | 6.4.7.18   | 842,701.04               | 1,343,463.81             |
| 减：二、费用                 |            | 27,770,298.88            | 38,223,245.82            |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 20,893,525.16            | 25,240,510.84            |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 3,095,336.96             | 3,739,334.90             |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | -                        | -                        |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.19   | 1,252,500.74             | 1,434,037.84             |
| 5. 利息支出                |            | 2,204,744.21             | 7,563,228.66             |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 2,204,744.21             | 7,563,228.66             |
| 6. 税金及附加               |            | 90,699.89                | -                        |
| 7. 其他费用                | 6.4.7.20   | 233,491.92               | 246,133.58               |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)    |            | 36,034,275.75            | 54,358,987.98            |
| 减：所得税费用                |            | -                        | -                        |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |            | 36,034,275.75            | 54,358,987.98            |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方安心保本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<br>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）                        | 2,984,850,514.97                | 236,734,657.82 | 3,221,585,172.79 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 36,034,275.75  | 36,034,275.75    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列）  | -189,272,704.96                 | -16,874,751.72 | -206,147,456.68  |
| 其中：1. 基金申购款                            | -                               | -              | -                |
| 2. 基金赎回款                               | -189,272,704.96                 | -16,874,751.72 | -206,147,456.68  |
| 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）                        | 2,795,577,810.01                | 255,894,181.85 | 3,051,471,991.86 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 3,666,045,067.74                | 166,171,125.36 | 3,832,216,193.10 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 54,358,987.98  | 54,358,987.98    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列）  | -168,347,745.38                 | -8,771,937.68  | -177,119,683.06  |
| 其中：1. 基金申购款                            | -                               | -              | -                |
| 2. 基金赎回款                               | -168,347,745.38                 | -8,771,937.68  | -177,119,683.06  |
| 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）                        | 3,497,697,322.36                | 211,758,175.66 | 3,709,455,498.02 |

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

南方安心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[2012]1359号《关于核准南方安心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《南方安心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2,413,483,107.29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(2012)第507号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方安心保本混合型证券投资基金基金合同》于2012年12月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,415,677,623.31份基金份额,其中认购资金利息折合2,194,516.02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,基金托管人为招商银行股份有限公司,担保人为重庆市三峡担保集团有限公司。

根据《南方安心保本混合型证券投资基金招募说明书》及2015年12月8日公告的《南方安心保本混合型证券投资基金保本期到期操作规则及转入下一保本期的相关规则公告》的相关规定,本基金第一个保本期到期操作结束后至第二个保本周期开始前设置过渡期,过渡期时间自2015年12月28日至2016年1月22日,此外,根据2015年12月29日发布的《关于南方安心保本混合型证券投资基金提前结束过渡期申购并转入第二个保本期的公告》,本基金于2015年12月29日起不再接受过渡期申购申请。过渡期的最后一个工作日即2015年12月28日为基金份额折算日,当日基金资产净值为3,983,638,962.28元,折算前基金份额总额为3,798,925,878.69份,折算前基金份额净值为1.049元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为1.048622450,折算后基金份额总额为3,983,638,962.28份,折算后基金份额净值为1.000元。南方基金管理股份有限公司已根据上述折算比例,对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算,并于2015年12月29日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方安心保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、各类债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证及中国证监会允许投资的其他金融工具。本基金投资组合中权益类资产投资比例为基金资产的0-40%,固定收益类资产占基金资产的比例不低于60%,其中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/申购保本金额的保证,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认购保本金额/申购保本金额，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：三年期定期存款税后收益率 + 0.5%。

#### 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》、《南方安心保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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。

#### 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 年半年度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 日的财务状况以及 2018 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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完全一致。

#### 6.4.5 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 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 2,395,964.66           |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月及以上   | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计             | 2,395,964.66           |

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2018年6月30日 |                  |                  |
|-------------------|-------------------|------------------|------------------|
|                   | 成本                | 公允价值             | 公允价值变动           |
| 股票                | 227,377,136.22    | 216,125,573.80   | -11,251,562.42   |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                 | -                | -                |
| 债券                | 交易所市场             | 398,754,486.49   | 396,584,450.00   |
|                   | 银行间市场             | 2,361,101,936.01 | 2,362,985,000.00 |
|                   | 合计                | 2,759,856,422.50 | 2,759,569,450.00 |
| 资产支持证券            | -                 | -                | -                |
| 基金                | -                 | -                | -                |
| 其他                | -                 | -                | -                |
| 合计                | 2,987,233,558.72  | 2,975,695,023.80 | -11,538,534.92   |

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 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<br>2018年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 20,000,000.00     | -         |
| 银行间市场 | -                 | -         |
| 合计    | 20,000,000.00     | -         |

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2018年6月30日 |
|----------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 7,951.45          |
| 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  | 1,524.90      |
| 应收债券利息     | 64,178,660.73 |
| 应收资产支持证券利息 | -             |
| 应收买入返售证券利息 | -             |
| 应收申购款利息    | -             |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -             |
| 其他         | 60.40         |
| 合计         | 64,188,197.48 |

#### 6.4.7.6 其他资产

注:无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 365,388.73        |
| 银行间市场应付交易费用 | 4,900.00          |
| 合计          | 370,288.73        |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 预提费用        | 199,347.97        |
| 合计          | 199,347.97        |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

| 项目            | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                  |
|---------------|----------------------------|------------------|
|               | 基金份额(份)                    | 账面金额             |
| 上年度末          | 3,130,020,252.27           | 2,984,850,514.97 |
| 本期申购          | -                          | -                |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -198,482,265.38            | -189,272,704.96  |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                          | -                |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                          | -                |
| 本期申购          | -                          | -                |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                          | -                |

|     |                  |                  |
|-----|------------------|------------------|
| 本期末 | 2,931,537,986.89 | 2,795,577,810.01 |
|-----|------------------|------------------|

注:申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 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           | 353,955,976.45 | -117,221,318.63 | 236,734,657.82 |
| 本期利润           | 46,410,926.57  | -10,376,650.82  | 36,034,275.75  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -23,700,286.25 | 6,825,534.53    | -16,874,751.72 |
| 其中:基金申购款       | -              | -               | -              |
| 基金赎回款          | -23,700,286.25 | 6,825,534.53    | -16,874,751.72 |
| 本期已分配利润        | -              | -               | -              |
| 本期末            | 376,666,616.77 | -120,772,434.92 | 255,894,181.85 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

| 项目        | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 56,253.61                  |
| 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 | 44,388.00                  |
| 其他        | 1,536.72                   |
| 合计        | 102,178.33                 |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位:人民币元

| 项目         | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 425,362,808.49             |
| 减:卖出股票成本总额 | 413,156,085.82             |
| 买卖股票差价收入   | 12,206,722.67              |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位:人民币元

| 项目                      | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额   | 1,367,186,515.68           |
| 减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额 | 1,330,669,150.71           |
| 减:应收利息总额                | 40,979,861.90              |

|          |               |
|----------|---------------|
| 买卖债券差价收入 | -4,462,496.93 |
|----------|---------------|

#### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注:无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注:无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注:无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

| 项目          | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 2,720,203.84               |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 2,720,203.84               |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

| 项目名称                    | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产              | -10,376,650.82             |
| 股票投资                    | -38,126,298.25             |
| 债券投资                    | 27,749,647.43              |
| 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                    | -                          |
| 3. 其他                   | -                          |
| 减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                          |
| 合计                      | -10,376,650.82             |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

| 项目      | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 842,701.04                 |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 842,701.04 |
|----|------------|

注:在保本到期前,本基金的赎回费率按持有期间递减,不低于赎回费总额的 50%归入基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

| 项目        | 本期<br>2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------|--|
| 交易所市场交易费用 | 1,244,350.74                           |
| 银行间市场交易费用 | 8,150.00                               |
| 合计        | 1,252,500.74                           |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

| 项目    | 本期<br>2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日 |
|-------|--|
| 审计费用  | 50,580.45                              |
| 信息披露费 | 148,767.52                             |
| 账户维护费 | 18,600.00                              |
| 银行费用  | 15,543.95                              |
| 合计    | 233,491.92                             |

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司(“招商银行”)   | 基金托管人、基金代销机构        |
| 华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)   | 基金管理人的股东、基金代销机构     |

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日 |                         | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日 |                         |
|-------|--|-------------------------|---|-------------------------|
|       | 成交金额                                   | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额  | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 华泰证券  | 45,719,796.59                          | 5.58                    | 454,845,847.73                              | 47.22                   |

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日 |                         | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日 |                         |
|-------|--|-------------------------|---|-------------------------|
|       | 成交金额                                   | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额  | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 华泰证券  | 96,935,962.73                          | 81.05                   | 272,051,607.76                              | 98.76                   |

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月<br>30 日 |                           | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日 |                           |
|-------|---|---------------------------|---|---------------------------|
|       | 成交金额                                      | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额  | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 华泰证券  | -   | -                         | 20,729,600,000.00                           | 78.27                     |

**6.4.10.1.4 权证交易**

注:无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至 2018年6月30日      |                       |              |                         |
|-------|----------------------------------|-----------------------|--------------|-------------------------|
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例<br>(%) | 期末应付佣<br>金余额 | 占期末应付佣金总额的<br>比例<br>(%) |
| 华泰证券  | 41,566.71                        | 5.57                  | -38.70       | -0.01                   |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至 2017年6月30日 |                       |              |                         |
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例<br>(%) | 期末应付佣<br>金余额 | 占期末应付佣金总额的<br>比例<br>(%) |
| 华泰证券  | 417,496.68                       | 47.37                 | 237,131.40   | 48.56                   |

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。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位:人民币元

| 项目              | 本期<br>2018年1月1日至 2018年<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至<br>2017年6月30日 |
|-----------------|---------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 20,893,525.16                   | 25,240,510.84                       |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 2,495,814.87                    | 3,469,332.74                        |

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 1.35%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 1.35% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2018年1月1日至 2018年 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至 |
|----|------------------------|-----------------------|
|----|------------------------|-----------------------|



|                | 6 月 30 日     | 2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|--------------|-----------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,095,336.96 | 3,739,334.90    |

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 0.20% 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 X 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注:无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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                               |           | 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 |            |
|            | 期末余额                             | 当期利息收入    | 期末余额                             | 当期利息收入     |
| 招商银行股份有限公司 | 2,395,964.66                     | 56,253.61 | 8,151,035.91                     | 163,309.21 |

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注:无。

**6.4.12 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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

| 6.4.12.1.1 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 |
| 603706               | 东方环宇 | 2018-06-29 | 2018-07-09 | 新股认购   | 13.09 | 13.09  | 1,765    | 23,103.85 | 23,103.85 | -  |

**6.4.12.2 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 | 复牌开盘单价 | 数量（股）   | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 600745 | 闻泰科技 | 2018-04-17 | 重大事项 | 25.55  | -    | -      | 117,900 | 3,439,156.75 | 3,012,345.00 | -  |

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。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

注：无。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

**6.4.13 金融工具风险及管理****6.4.13.1 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争取将以上风险控制在限定的范围之内，控制本金损失的风险，并在三年保本期到期时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。

#### 6.4.13.2 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招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2018 年 6 月 30 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 85.18% (2017 年 12 月 31 日：88.32%)。

#### 6.4.13.3 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 2018 年 6 月 30 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。

#### 6.4.13.3.1 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上市公司发行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。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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2018 年<br>6 月 30 日 | 1 年以内            | 1-5 年          | 5 年以上 | 不计息             | 合计               |
|---------------------------|------------------|----------------|-------|-----------------|------------------|
| 资产                        |                  |                |       |                 |                  |
| 银行存款                      | 2,395,964.66     | -              | -     | -               | 2,395,964.66     |
| 结算备付金                     | 3,388,542.78     | -              | -     | -               | 3,388,542.78     |
| 存出保证金                     | 134,123.05       | -              | -     | -               | 134,123.05       |
| 交易性金融资产                   | 2,427,656,100.00 | 331,913,350.00 | -     | -216,125,573.80 | 2,975,695,023.80 |
| 买入返售金融资产                  | 20,000,000.00    | -              | -     | -               | 20,000,000.00    |
| 应收利息                      | -                | -              | -     | 64,188,197.48   | 64,188,197.48    |
| 应收股利                      | -                | -              | -     | -               | -                |
| 应收申购款                     | -                | -              | -     | -               | -                |
| 应收证券清                     | -                | -              | -     | 18,281,006.03   | 18,281,006.03    |

|                             |                  |                |               |                 |                  |
|-----------------------------|------------------|----------------|---------------|-----------------|------------------|
| 算款                          |                  |                |               |                 |                  |
| 其他资产                        | -                | -              | -             | -               | -                |
| 资产总计                        | 2,453,574,730.49 | 331,913,350.00 |               | -298,594,777.31 | 3,084,082,857.80 |
| 负债                          |                  |                |               |                 |                  |
| 应付赎回款                       | -                | -              | -             | -               | -                |
| 应付管理人报酬                     | -                | -              | -             | 3,400,385.76    | 3,400,385.76     |
| 应付托管费                       | -                | -              | -             | 503,760.85      | 503,760.85       |
| 应付证券清算款                     | -                | -              | -             | -               | -                |
| 卖出回购金融资产款                   | 28,000,000.00    | -              | -             | -               | 28,000,000.00    |
| 应付销售服务费                     | -                | -              | -             | -               | -                |
| 应付交易费用                      | -                | -              | -             | 370,288.73      | 370,288.73       |
| 应付利息                        | -                | -              | -             | -               | -                |
| 应付利润                        | -                | -              | -             | -               | -                |
| 应交税费                        | -                | -              | -             | 137,082.63      | 137,082.63       |
| 其他负债                        | -                | -              | -             | 199,347.97      | 199,347.97       |
| 负债总计                        | 28,000,000.00    | -              | -             | 4,610,865.94    | 32,610,865.94    |
| 利率敏感度缺口                     | 2,425,574,730.49 | 331,913,350.00 |               | -293,983,911.37 | 3,051,471,991.86 |
| 上年度末<br>2017 年<br>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                        | 16,163,983.65    | -              | -             | -               | 16,163,983.65    |
| 结算备付金                       | 9,912,181.48     | -              | -             | -               | 9,912,181.48     |
| 存出保证金                       | 203,639.13       | -              | -             | -               | 203,639.13       |
| 交易性金融资产                     | 2,561,819,400.00 | 439,938,855.80 | 13,932,376.40 | 272,061,923.13  | 3,287,752,555.33 |
| 买入返售金融资产                    | 20,000,000.00    | -              | -             | -               | 20,000,000.00    |
| 应收利息                        | -                | -              | -             | 50,096,475.20   | 50,096,475.20    |
| 应收股利                        | -                | -              | -             | -               | -                |
| 应收申购款                       | -                | -              | -             | -               | -                |
| 应收证券清算款                     | -                | -              | -             | 10,104,268.67   | 10,104,268.67    |
| 其他资产                        | -                | -              | -             | -               | -                |
| 资产总计                        | 2,608,099,204.26 | 439,938,855.80 | 13,932,376.40 | 332,262,667.00  | 3,394,233,103.46 |
| 负债                          |                  |                |               |                 |                  |
| 应付赎回款                       | -                | -              | -             | -               | -                |
| 应付管理人                       | -                | -              | -             | 3,724,452.82    | 3,724,452.82     |

|           |                  |                |               |                |                  |
|-----------|------------------|----------------|---------------|----------------|------------------|
| 报酬        |                  |                |               |                |                  |
| 应付托管费     |                  | -              | -             | 551,770.80     | 551,770.80       |
| 应付证券清算款   |                  | -              | -             | -              | -                |
| 卖出回购金融资产款 | 167,000,000.00   | -              | -             | -              | 167,000,000.00   |
| 应付销售服务费   |                  | -              | -             | -              | -                |
| 应付交易费用    |                  | -              | -             | 732,024.89     | 732,024.89       |
| 应付利息      |                  | -              | -             | 242,682.16     | 242,682.16       |
| 应付利润      |                  | -              | -             | -              | -                |
| 其他负债      |                  | -              | -             | 397,000.00     | 397,000.00       |
| 负债总计      | 167,000,000.00   | -              | -             | 5,647,930.67   | 172,647,930.67   |
| 利率敏感度缺口   | 2,441,099,204.26 | 439,938,855.80 | 13,932,376.40 | 326,614,736.33 | 3,221,585,172.79 |

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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<br>(2018年6月30日)         | 上年度末<br>(2017年12月31日) |               |
| 分析        | 1. 市场利率下降 25 个基点            | 3,112,825.86          | 6,435,417.14  |
|           | 2. 市场利率上升 25 个基点            | -3,112,702.61         | -6,396,793.98 |

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。本基金根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，按照投资组合保险机制对债券和股票的投资比例进行动态调整。本基金投资组合中权益类资产投资比例为基金资产的 0-40%，固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |                      | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |                   |
|---------------|------------------------|----------------------|--------------------------|-------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资产净<br>值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 216,125,573.80         | 7.08                 | 272,061,923.13           | 8.44              |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | —                    | —                        | —                 |
| 交易性金融资产—债券投资  | —                      | —                    | —                        | —                 |
| 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            | 216,125,573.80         | 7.08                 | 272,061,923.13           | 8.44              |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2018 年 6 月 30 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 7.08% (2017 年 12 月 31 日：8.44%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2017 年 12 月 31 日：同)。



**6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

注:无。

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

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               | 216,125,573.80   | 7.01          |
|    | 其中: 股票             | 216,125,573.80   | 7.01          |
| 2  | 基金投资               | 0.00             | -             |
| 3  | 固定收益投资             | 2,759,569,450.00 | 89.48         |
|    | 其中: 债券             | 2,759,569,450.00 | 89.48         |
|    | 资产支持证券             | 0.00             | -             |
| 4  | 贵金属投资              | 0.00             | -             |
| 5  | 金融衍生品投资            | 0.00             | -             |
| 6  | 买入返售金融资产           | 20,000,000.00    | 0.65          |
|    | 其中: 买断式回购的买入返售金融资产 | 0.00             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计       | 5,784,507.44     | 0.19          |
| 8  | 其他各项资产             | 82,603,326.56    | 2.68          |
|    | 合计                 | 3,084,082,857.80 | 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         | 0.00           | 0.00          |
| B  | 采矿业              | 0.00           | 0.00          |
| C  | 制造业              | 133,213,658.70 | 4.37          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,511,999.85   | 0.05          |
| E  | 建筑业              | 0.00           | 0.00          |
| F  | 批发和零售业           | 10,317,557.60  | 0.34          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 4,254,630.40   | 0.14          |
| H  | 住宿和餐饮业           | 0.00           | 0.00          |

|   |                 |                |      |
|---|-----------------|----------------|------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 7,920,729.00   | 0.26 |
| J | 金融业             | 46,730,671.25  | 1.53 |
| K | 房地产业            | 2,342,400.00   | 0.08 |
| L | 租赁和商务服务业        | 9,833,927.00   | 0.32 |
| M | 科学研究和技术服务业      | 0.00           | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 0.00           | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | 0.00           | 0.00 |
| P | 教育              | 0.00           | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作         | 0.00           | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 0.00           | 0.00 |
| S | 综合              | 0.00           | 0.00 |
|   | 合计              | 216,125,573.80 | 7.08 |

## 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  | 601166 | 兴业银行 | 1,102,100 | 15,870,240.00 | 0.52         |
| 2  | 000651 | 格力电器 | 249,425   | 11,760,388.75 | 0.39         |
| 3  | 000786 | 北新建材 | 633,661   | 11,741,738.33 | 0.38         |
| 4  | 002511 | 中顺洁柔 | 1,125,190 | 10,599,289.80 | 0.35         |
| 5  | 601398 | 工商银行 | 1,676,000 | 8,916,320.00  | 0.29         |
| 6  | 600519 | 贵州茅台 | 9,600     | 7,022,016.00  | 0.23         |
| 7  | 000568 | 泸州老窖 | 96,500    | 5,872,990.00  | 0.19         |
| 8  | 601288 | 农业银行 | 1,685,600 | 5,798,464.00  | 0.19         |
| 9  | 000333 | 美的集团 | 109,700   | 5,728,534.00  | 0.19         |
| 10 | 600872 | 中炬高新 | 179,300   | 5,020,400.00  | 0.16         |
| 11 | 600406 | 国电南瑞 | 312,600   | 4,939,080.00  | 0.16         |
| 12 | 601818 | 光大银行 | 1,291,200 | 4,725,792.00  | 0.15         |
| 13 | 600066 | 宇通客车 | 240,100   | 4,607,519.00  | 0.15         |
| 14 | 600741 | 华域汽车 | 193,000   | 4,577,960.00  | 0.15         |
| 15 | 002027 | 分众传媒 | 475,200   | 4,547,664.00  | 0.15         |
| 16 | 002597 | 金禾实业 | 192,600   | 3,905,928.00  | 0.13         |
| 17 | 600690 | 青岛海尔 | 182,900   | 3,522,654.00  | 0.12         |
| 18 | 002236 | 大华股份 | 153,700   | 3,465,935.00  | 0.11         |
| 19 | 600887 | 伊利股份 | 123,700   | 3,451,230.00  | 0.11         |
| 20 | 002384 | 东山精密 | 137,500   | 3,300,000.00  | 0.11         |
| 21 | 601336 | 新华保险 | 73,900    | 3,168,832.00  | 0.10         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 22 | 600486 | 扬农化工 | 55,400  | 3,098,522.00 | 0.10 |
| 23 | 601009 | 南京银行 | 398,000 | 3,076,540.00 | 0.10 |
| 24 | 600745 | 闻泰科技 | 117,900 | 3,012,345.00 | 0.10 |
| 25 | 002415 | 海康威视 | 77,900  | 2,892,427.00 | 0.09 |
| 26 | 600138 | 中青旅  | 143,900 | 2,867,927.00 | 0.09 |
| 27 | 600030 | 中信证券 | 171,800 | 2,846,726.00 | 0.09 |
| 28 | 000028 | 国药一致 | 52,900  | 2,639,710.00 | 0.09 |
| 29 | 002462 | 嘉事堂  | 127,274 | 2,469,115.60 | 0.08 |
| 30 | 002707 | 众信旅游 | 251,910 | 2,418,336.00 | 0.08 |
| 31 | 600809 | 山西汾酒 | 38,400  | 2,414,976.00 | 0.08 |
| 32 | 002035 | 华帝股份 | 97,857  | 2,390,646.51 | 0.08 |
| 33 | 600048 | 保利地产 | 192,000 | 2,342,400.00 | 0.08 |
| 34 | 601601 | 中国太保 | 73,085  | 2,327,757.25 | 0.08 |
| 35 | 600309 | 万华化学 | 47,300  | 2,148,366.00 | 0.07 |
| 36 | 002024 | 苏宁易购 | 143,400 | 2,019,072.00 | 0.07 |
| 37 | 603883 | 老百姓  | 23,600  | 1,962,576.00 | 0.06 |
| 38 | 603885 | 吉祥航空 | 122,540 | 1,888,341.40 | 0.06 |
| 39 | 300122 | 智飞生物 | 40,500  | 1,852,470.00 | 0.06 |
| 40 | 300138 | 晨光生物 | 259,180 | 1,827,219.00 | 0.06 |
| 41 | 002851 | 麦格米特 | 62,400  | 1,827,072.00 | 0.06 |
| 42 | 600884 | 杉杉股份 | 80,700  | 1,783,470.00 | 0.06 |
| 43 | 000977 | 浪潮信息 | 70,900  | 1,690,965.00 | 0.06 |
| 44 | 603515 | 欧普照明 | 35,570  | 1,662,541.80 | 0.05 |
| 45 | 600211 | 西藏药业 | 45,000  | 1,608,750.00 | 0.05 |
| 46 | 600585 | 海螺水泥 | 47,300  | 1,583,604.00 | 0.05 |
| 47 | 300296 | 利亚德  | 122,150 | 1,573,292.00 | 0.05 |
| 48 | 002262 | 恩华药业 | 78,600  | 1,572,786.00 | 0.05 |
| 49 | 603337 | 杰克股份 | 40,261  | 1,564,945.07 | 0.05 |
| 50 | 603788 | 宁波高发 | 63,400  | 1,562,176.00 | 0.05 |
| 51 | 000338 | 潍柴动力 | 177,900 | 1,556,625.00 | 0.05 |
| 52 | 300124 | 汇川技术 | 46,400  | 1,522,848.00 | 0.05 |
| 53 | 000960 | 锡业股份 | 126,300 | 1,516,863.00 | 0.05 |
| 54 | 002376 | 新北洋  | 91,500  | 1,513,410.00 | 0.05 |
| 55 | 600886 | 国投电力 | 204,800 | 1,488,896.00 | 0.05 |
| 56 | 300009 | 安科生物 | 78,200  | 1,442,008.00 | 0.05 |
| 57 | 002152 | 广电运通 | 240,800 | 1,415,904.00 | 0.05 |
| 58 | 000830 | 鲁西化工 | 74,900  | 1,279,292.00 | 0.04 |
| 59 | 002396 | 星网锐捷 | 61,100  | 1,250,717.00 | 0.04 |
| 60 | 600337 | 美克家居 | 209,400 | 1,227,084.00 | 0.04 |
| 61 | 300523 | 辰安科技 | 19,700  | 1,226,916.00 | 0.04 |
| 62 | 600548 | 深高速  | 150,900 | 1,184,565.00 | 0.04 |
| 63 | 600009 | 上海机场 | 21,300  | 1,181,724.00 | 0.04 |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 64 | 300059 | 东方财富 | 69,300 | 913,374.00 | 0.03 |
| 65 | 603848 | 好太太  | 37,900 | 897,851.00 | 0.03 |
| 66 | 300559 | 佳发安泰 | 28,300 | 841,359.00 | 0.03 |
| 67 | 300747 | 锐科激光 | 1,543  | 123,995.48 | 0.00 |
| 68 | 603650 | 彤程新材 | 2,376  | 50,988.96  | 0.00 |
| 69 | 603706 | 东方环宇 | 1,765  | 23,103.85  | 0.00 |

## 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  | 601166 | 兴业银行 | 20,253,778.00 | 0.63            |
| 2  | 601229 | 上海银行 | 11,052,075.70 | 0.34            |
| 3  | 002027 | 分众传媒 | 9,448,506.60  | 0.29            |
| 4  | 600406 | 国电南瑞 | 7,939,465.00  | 0.25            |
| 5  | 601288 | 农业银行 | 6,479,710.00  | 0.20            |
| 6  | 002236 | 大华股份 | 6,292,978.00  | 0.20            |
| 7  | 601818 | 光大银行 | 5,709,836.00  | 0.18            |
| 8  | 600809 | 山西汾酒 | 5,672,771.00  | 0.18            |
| 9  | 002482 | 广田集团 | 4,998,155.52  | 0.16            |
| 10 | 002310 | 东方园林 | 4,656,773.00  | 0.14            |
| 11 | 600048 | 保利地产 | 4,376,377.00  | 0.14            |
| 12 | 300308 | 中际旭创 | 4,264,840.77  | 0.13            |
| 13 | 600138 | 中青旅  | 3,841,510.78  | 0.12            |
| 14 | 601899 | 紫金矿业 | 3,793,509.00  | 0.12            |
| 15 | 002094 | 青岛金王 | 3,745,576.40  | 0.12            |
| 16 | 600585 | 海螺水泥 | 3,743,206.50  | 0.12            |
| 17 | 600690 | 青岛海尔 | 3,674,288.00  | 0.11            |
| 18 | 000998 | 隆平高科 | 3,527,847.00  | 0.11            |
| 19 | 600745 | 闻泰科技 | 3,477,671.00  | 0.11            |
| 20 | 600340 | 华夏幸福 | 3,475,493.00  | 0.11            |

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  | 601318 | 中国平安 | 17,461,682.00 | 0.54            |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 2  | 601229 | 上海银行  | 10,792,388.71 | 0.34 |
| 3  | 002714 | 牧原股份  | 9,564,349.04  | 0.30 |
| 4  | 000858 | 五 粮 液 | 8,948,719.56  | 0.28 |
| 5  | 601766 | 中国中车  | 8,653,320.44  | 0.27 |
| 6  | 300072 | 三聚环保  | 8,096,297.26  | 0.25 |
| 7  | 002142 | 宁波银行  | 7,534,034.88  | 0.23 |
| 8  | 002511 | 中顺洁柔  | 7,314,895.20  | 0.23 |
| 9  | 002027 | 分众传媒  | 7,303,472.20  | 0.23 |
| 10 | 300308 | 中际旭创  | 6,907,619.25  | 0.21 |
| 11 | 600900 | 长江电力  | 6,378,701.09  | 0.20 |
| 12 | 603515 | 欧普照明  | 5,626,786.60  | 0.17 |
| 13 | 600048 | 保利地产  | 5,536,256.58  | 0.17 |
| 14 | 000830 | 鲁西化工  | 5,423,537.52  | 0.17 |
| 15 | 603899 | 晨光文具  | 5,249,762.19  | 0.16 |
| 16 | 600703 | 三安光电  | 5,014,212.67  | 0.16 |
| 17 | 601888 | 中国国旅  | 4,997,409.00  | 0.16 |
| 18 | 002310 | 东方园林  | 4,663,417.50  | 0.14 |
| 19 | 601100 | 恒立液压  | 4,619,421.94  | 0.14 |
| 20 | 002482 | 广田集团  | 4,512,175.00  | 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 | 395,346,034.74 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 425,362,808.49 |

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      | 0.00             | 0.00         |
| 2  | 央行票据      | 0.00             | 0.00         |
| 3  | 金融债券      | 160,176,000.00   | 5.25         |
|    | 其中:政策性金融债 | 160,176,000.00   | 5.25         |
| 4  | 企业债券      | 396,584,450.00   | 13.00        |
| 5  | 企业短期融资券   | 602,541,000.00   | 19.75        |
| 6  | 中期票据      | 487,899,000.00   | 15.99        |
| 7  | 可转债(可交换债) | 0.00             | 0.00         |
| 8  | 同业存单      | 1,112,369,000.00 | 36.45        |
| 9  | 其他        | 0.00             | 0.00         |

|  |    |                  |       |
|--|----|------------------|-------|
|  | 合计 | 2,759,569,450.00 | 90.43 |
|--|----|------------------|-------|

## 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  | 111714244 | 17 江苏银行 CD244 | 2,000,000 | 191,300,000.00 | 6.27         |
| 2  | 111812081 | 18 北京银行 CD081 | 1,000,000 | 96,800,000.00  | 3.17         |
| 3  | 136176    | 16 绿地 01      | 845,000   | 83,004,350.00  | 2.72         |
| 4  | 1182359   | 11 中远 MTN1    | 800,000   | 80,824,000.00  | 2.65         |
| 5  | 101555031 | 15 中建材 MTN002 | 800,000   | 80,168,000.00  | 2.63         |

## 7.7 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

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

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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和投资组合的 $\beta$ 值

本基金管理人将根据 TIPP 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，通过做多股指期货建立多头头寸；反之，当需要降低风险资产头寸时，通过做空股指期货建立股指期货空头头寸。另一方面，本基金管理人还将利用股指期货调整投资组合

的  $\beta$  值，利用股指期货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。

## (2) $\alpha$ 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股票市场的系统风险。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。

## 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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   | 134,123.05    |
| 2  | 应收证券清算款 | 18,281,006.03 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 64,188,197.48 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
|    | 合计      | 82,603,326.56 |

### 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<br>(户) | 户均持有的基金<br>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<br>比例 (%) | 持有份额             | 占总份额<br>比例 (%) |
| 12,794       | 229,133.81    | 1,666,962,380.50 | 56.86          | 1,264,575,606.39 | 43.14          |

### 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<br>(%) |
|------------------|------------|-----------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 4,350.85   | 0.0001          |

### 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：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

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2012年12月21日）基金份额总额 | 2,415,677,623.31 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 3,130,020,252.27 |
| 本报告期基金总申购份额                | -                |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 198,482,265.38   |
| 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               | 2,931,537,986.89 |

## § 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，基金管理人没有发生重大人事变动。

本报告期内，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(特殊普通合伙)。

**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 |    |
| 广发证券 | 1      | 248,909,764.48 | 30.39%       | 226,712.10 | 30.39%     |    |
| 银河证券 | 1      | 209,874,834.67 | 25.63%       | 191,258.74 | 25.63%     |    |
| 西藏东财 | 1      | 197,613,754.48 | 24.13%       | 180,082.78 | 24.14%     |    |
| 方正证券 | 1      | 116,839,194.97 | 14.27%       | 106,472.29 | 14.27%     |    |
| 华泰证券 | 2      | 45,719,796.59  | 5.58%        | 41,566.71  | 5.57%      |    |
| 万联证券 | 1      | 0.00           | 0.00%        | 0.00       | 0.00%      |    |
| 华创证券 | 1      | 0.00           | 0.00%        | 0.00       | 0.00%      |    |
| 国信证券 | 1      | 0.00           | 0.00%        | 0.00       | 0.00%      |    |
| 中投证券 | 1      | 0.00           | 0.00%        | 0.00       | 0.00%      |    |

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 |
| 方正证券 | 104,415.00    | 0.09%        | 0.00             | 0.00%          | 0.00 | 0.00%        |
| 广发证券 | 2,973,277.51  | 2.49%        | 0.00             | 0.00%          | 0.00 | 0.00%        |
| 国信证券 | 0.00          | 0.00%        | 0.00             | 0.00%          | 0.00 | 0.00%        |
| 华创证券 | 0.00          | 0.00%        | 0.00             | 0.00%          | 0.00 | 0.00%        |
| 华泰证券 | 96,935,962.73 | 81.05%       | 0.00             | 0.00%          | 0.00 | 0.00%        |
| 万联证券 | 0.00          | 0.00%        | 0.00             | 0.00%          | 0.00 | 0.00%        |
| 西藏东财 | 18,003,765.54 | 15.05%       | 2,743,100,000.00 | 51.35%         | 0.00 | 0.00%        |
| 银河证券 | 1,588,707.91  | 1.33%        | 2,598,700,000.00 | 48.65%         | 0.00 | 0.00%        |
| 中投证券 | 0.00          | 0.00%        | 0.00             | 0.00%          | 0.00 | 0.00%        |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                   | 法定披露方式           | 法定披露日期      |
|----|--|------------------|-------------|
| 1  | 南方基金管理有限公司关于东海期货有限责任公司终止代理销售本公司旗下基金的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2018年01月05日 |
| 2  | 南方安心保本混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2017年第2号)     | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2018年01月26日 |
| 3  | 南方安心保本混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2017年第2号)   | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2018年01月26日 |
| 4  | 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 | 2018年01月06日 |
| 5  | 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 | 2018年01月06日 |
| 6  | 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 | 2018年01月06日 |
| 7  | 南方基金管理股份有限公司关于旗下部分开放式基金赎回费调整的提示性公告     | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2018年03月27日 |
| 8  | 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 | 2018年01月06日 |
| 9  | 南方基金管理股份有限公司关于调整电子直销系统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 | 2018年04月26日 |
| 10 | 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 | 2018年01月06日 |

## § 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

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                |      |      | 报告期末持有基金情况     |         |
|---|----------------|-------------------------|----------------|------|------|----------------|---------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额           | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额           | 份额占比(%) |
| 机构  | 1              | 20180101-20180630       | 909,360,275.00 | -    | -    | 909,360,275.00 | 31.02   |
| 产品特有风险  |                |                         |                |      |      |                |         |
| 本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。 |                |                         |                |      |      |                |         |

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方安心保本混合型证券投资基金的文件。
- 2、南方安心保本混合型证券投资基金基金合同。
- 3、南方安心保本混合型证券投资基金托管协议。
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 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。

### 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>