

南方益和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：中国建设银行股份有限公司

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及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本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。

基金托管人中国建设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、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	11
2.1 基金基本情况	11
2.2 基金产品说明	11
2.3 基金管理人和基金托管人	11
2.4 信息披露方式	11
2.5 其他相关资料	11
§3 主要财务指标和基金净值表现	11
3.1 主要会计数据和财务指标	11
3.2 基金净值表现	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告	22
7.1 期末基金资产组合情况	22
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	22
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	22
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	22
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	22
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	22

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细	22
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	22
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	23
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	23
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	23
7.12 投资组合报告附注	23
§8 基金份额持有人信息	24
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	24
8.2 期末上市基金前十名持有人	24
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	24
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	24
§9 开放式基金份额变动	24
§10 重大事件揭示	24
10.1 基金份额持有人大会决议	24
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	24
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	25
10.4 基金投资策略的改变	25
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	25
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	25
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	25
10.8 其他重大事件	25
§11 影响投资者决策的其他重要信息	25
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	25
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	25
§12 备查文件目录	25
12.1 备查文件目录	25
12.2 存放地点	26
12.3 查阅方式	26

基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方益和保本混合型证券投资基金
基金简称	南方益和保本
基金主代码	002293
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年1月11日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,239,741,476.01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“南方益和保本”。

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	本基金采用恒定比例投资组合保险策略 (Constant-Proportion Portfolio Insurance, CPPI) 来实现保本和增值的目标。恒定比例投资组合保险策略不仅能从投资组合资产配置层面上使基金保本到期日基金净值低于本金的概率最小化, 而且还能在一定程度上使保本基金受益于股票市场在中长期内整体性上涨的特点。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为: 三年期定期存款税后收益率+0.5%。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金, 属于证券投资基金中的低风险品种, 预期收益和预期风险高于货币市场基金, 低于股票基金和一般混合基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
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	010-67595096
传真	0755-82763889	010-66275853
注册地址	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层	北京市西城区金融大街25号
办公地址	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层	北京市西城区闹市口大街一号院一号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	张海波	田国立

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	深圳市高新投集团有限公司	深圳市福田区深南大道7028号时代科技大厦22/23楼东

§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	40,749,526.72
本期利润	18,646,459.02
加权平均基金份额本期利润	0.0081
本期加权平均净值利润率	0.75%
本期基金份额净值增长率	0.65%
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	182,008,114.35
期末可供分配基金份额利润	0.0813
期末基金资产净值	2,421,749,590.36
期末基金份额净值	1.081
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	8.10%

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。

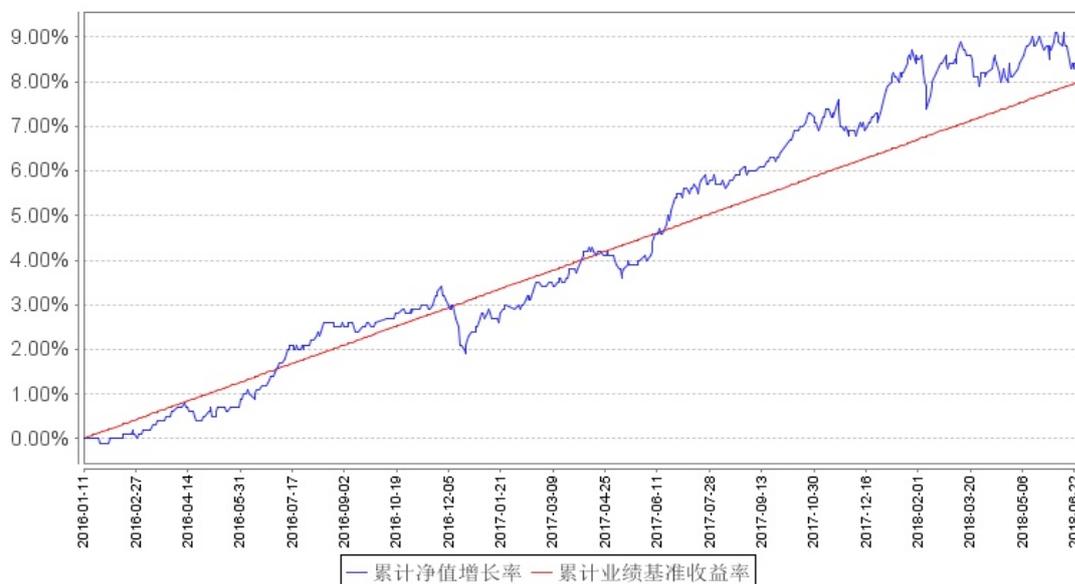
3.2 基金净值表现

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	-0.64%	0.19%	0.25%	0.01%	-0.89%	0.18%
过去三个月	-0.09%	0.16%	0.76%	0.01%	-0.85%	0.15%
过去六个月	0.65%	0.16%	1.51%	0.01%	-0.86%	0.15%
过去一年	2.46%	0.13%	3.10%	0.01%	-0.64%	0.12%
自基金合同 生效起至今	8.10%	0.10%	8.03%	0.01%	0.07%	0.09%

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

南方益和保本累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金的建仓期为六个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。2、本基金的第一个保本期为三年，自2016年1月11日至2019年1月11日止。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金3亿元人民币。目前股权结构：华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——

南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超8,200亿元，旗下管理168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		
孙鲁闽	本基金基金经理	2016年1月11日 -		15	南开大学理学和经济学双学士、澳大利亚新南威尔士大学商学硕士，具有基金从业资格。曾任职于厦门国际银行福州分行，2003年4月加入南方基金，历任行业研究员、南方高增和南方隆元的基金经理助理、专户投资管理部总监助理、权益投资部副总监，现任权益投资部董事总经理；2007年12月至2010年10月，担任南方基金企业年金和专户的投资经理。2011年6月至2017年7月，任南方保本基金经理；2015年12月至2017年12月，任南方瑞利保本基金经理；2015年5月至2018年6月，任南方丰合保本基金经理；2010年12月至今，任南方避险基金经理；2015年4月至今，任南方利淘基金经理；2015年5月至今，任南方利鑫基金经理；2016年1月至今，任南方益和保本基金经理；2016年9月至今，任南方安泰混合基金经理；2016年11月至今，任南方安裕混合基金经理；2017年7月至今，任南

					方安睿混合基金经理；2017年12月至今，任南方瑞利混合基金经理；2018年1月至今，任南方融尚再融资基金经理；2018年6月至今，任南方新蓝筹混合、南方改革机遇、南方甌智混合基金经理。
--	--	--	--	--	---

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《南方益和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，A股市场表现较差，沪深300跌幅13%，中证1000跌幅20%。国际环境方面，美国加息周期推进，全球收益率震荡上行；同时中美贸易战问题持续发酵，对整体市场的风险偏好造成压制。国内环境方面，在金融去杠杆的大背景下，市场流动性比较紧张；政府支出下降，社融等前瞻性经济数据偏弱，市场担心投资对经济的驱动弱化；信用违约事件对企业经营、风险偏好等都造成了负面影响。

债券方面，2018年上半年一年期国债、AAA利率债收益率分别下降64bp、67bp。

回顾上半年，本基金股票仓位基本稳定。在风格上本基金的核心股票仓位投向低估值、高分红、具有安全边际的价值股，同时积极寻找具有竞争优势的白马股投资机会。固定收益投资上，本基金以短久期、高流动性、高评级的债券或存单适当加杠杆进行配置来获取稳定的持有收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值增长率为0.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年下半年，我们认为股票市场存在结构性机会。从大类资产配置的角度，中国居民长期低配金融资产、超配房地产，而未来一段时间房地产面临政策压制，未来金融资产的表现值得期待。从多个成熟市场过去的长期回报来看，股票的收益率高于房地产和债券，是长期表现最优秀的资产之一。从估值的角度来看，2018年以来，上市公司盈利持续增长，而主要股指跌幅较大，当前主要股指的估值状态已经接近历史低位，当前市场的估值吸引力较2016年1月末的时候更大。随着未来中国资本市场的开放度逐步增加，我们认为A股未来估值更加国际化，具备竞争优势的行业龙头将取得估值溢价。

从经济结构的角度来看，随着人均GDP提升，投资在经济中的占比逐步下降，消费占比逐步提升，反映到股市上，我们认为未来A股的波动率有望下降。我们认为，当前A股整体估值较低，波动率下降之后有望走出慢牛行情。

债券方面，我们仍然维持之前的持有到期策略，主要配置高评级信用债。

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；本基金在保本基金阶段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“南方益和灵活配置混合型证券投资基金”后，收益分配方式分为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；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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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：南方益和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 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	107,001,143.85	143,355,386.94
结算备付金		7,788,439.94	6,669,816.48
存出保证金		69,171.00	44,877.30
交易性金融资产	6.4.4.2	2,460,353,793.48	2,481,581,340.11
其中：股票投资		315,963,281.06	292,011,621.47
基金投资		-	-

债券投资		2,144,390,512.42	2,189,569,718.64
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	4,200,000.00	2,000,000.00
应收证券清算款		-	2,646,140.62
应收利息	6.4.4.5	42,997,571.09	47,491,424.85
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		2,622,410,119.36	2,683,788,986.30
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		192,000,000.00	131,000,000.00
应付证券清算款		5,055,892.10	1,584,228.30
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,607,044.48	2,823,339.44
应付托管费		401,083.79	434,359.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	207,040.02	169,419.11
应交税费		91,652.26	-
应付利息		99,460.26	169,279.88
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	198,356.09	391,000.00
负债合计		200,660,529.00	136,571,626.64
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	2,239,741,476.01	2,372,687,736.22
未分配利润	6.4.4.10	182,008,114.35	174,529,623.44
所有者权益合计		2,421,749,590.36	2,547,217,359.66
负债和所有者权益总计		2,622,410,119.36	2,683,788,986.30

注：

1. 报告截止日2018年06月30日，基金份额净值1.081元，基金份额总额2,239,741,476.01份

。

6.2 利润表

会计主体：南方益和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 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
一、收入		42,832,697.71	107,206,145.38
1.利息收入		48,572,680.37	48,987,086.85
其中：存款利息收入	6.4.4.11	2,540,591.17	2,336,409.21
债券利息收入		45,750,091.20	46,365,550.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		281,998.00	285,127.25
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,642,511.22	43,281,693.45
其中：股票投资收益	6.4.4.12	14,105,485.72	37,239,027.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	-2,949,962.00	2,866,902.72
资产支持证券投资收益	6.4.4.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.4.14	-	-
衍生工具收益	6.4.4.15	-	-
股利收益	6.4.4.16	4,486,987.50	3,175,763.31
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.4.17	-22,103,067.70	11,508,830.96
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.4.18	720,573.82	3,428,534.12
减：二、费用		24,186,238.69	27,504,579.34
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	16,008,842.22	18,068,572.49
2. 托管费	6.4.7.2.2	2,462,898.86	2,779,780.37
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.4.19	656,057.15	731,238.97
5. 利息支出		4,758,943.43	5,693,786.19
其中：卖出回购金融资产支出		4,758,943.43	5,693,786.19
6. 税金及附加		72,028.70	-
7. 其他费用	6.4.4.20	227,468.33	231,201.32
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		18,646,459.02	79,701,566.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,646,459.02	79,701,566.04

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方益和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 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）	2,372,687,736.22	174,529,623.44	2,547,217,359.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,646,459.02	18,646,459.02
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）	-132,946,260.21	-11,167,968.11	-144,114,228.32
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-132,946,260.21	-11,167,968.11	-144,114,228.32
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）	2,239,741,476.01	182,008,114.35	2,421,749,590.36
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,879,706,707.11	72,976,810.00	2,952,683,517.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	79,701,566.04	79,701,566.04
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）	-330,525,206.05	-12,327,980.74	-342,853,186.79
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-330,525,206.05	-12,327,980.74	-342,853,186.79
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）	2,549,181,501.06	140,350,395.30	2,689,531,896.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

杨小松	徐超	徐超
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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。

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
活期存款	7,001,143.85
定期存款	100,000,000.00
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	100,000,000.00
其他存款	-
合计	107,001,143.85

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	325,133,059.92	315,963,281.06	-9,169,778.86
贵金属投资- 金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	648,436,677.21	630,998,512.42
	银行间市场	1,517,983,914.22	1,513,392,000.00
	-	-	-
	合计	2,166,420,591.43	2,144,390,512.42
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,491,553,651.35	2,460,353,793.48	-31,199,857.87

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.4.4 买入返售金融资产**6.4.4.4.1 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 2018年6月30日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
交易所市场	4,200,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	4,200,000.00	-

6.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	1,034.96
应收定期存款利息	4,362,500.00
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,504.80
应收债券利息	38,630,500.23
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	31.10
合计	42,997,571.09

6.4.4.6 其他资产

注：无。

6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	205,290.02
银行间市场应付交易费用	1,750.00
-	-
合计	207,040.02

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	198,356.09
合计	198,356.09

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 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	2,372,687,736.22	2,372,687,736.22
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-132,946,260.21	-132,946,260.21
- 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	2,239,741,476.01	2,239,741,476.01

注：：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额

6.4.4.10 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	183,156,385.65	-8,626,762.21	174,529,623.44
本期利润	40,749,526.72	-22,103,067.70	18,646,459.02
本期基金份额交易产生的变动数	-11,131,480.96	-36,487.15	-11,167,968.11
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-11,131,480.96	-36,487.15	-11,167,968.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	212,774,431.41	-30,766,317.06	182,008,114.35

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	2,424,500.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	58,668.72
其他	472.74
合计	2,540,591.17

6.4.4.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	200,800,968.28
减：卖出股票成本总额	186,695,482.56
买卖股票差价收入	14,105,485.72

6.4.4.13 债券投资收益

6.4.4.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	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	846,468,372.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	815,883,853.70
减：应收利息总额	33,534,480.30
买卖债券差价收入	-2,949,962.00

6.4.4.13.2 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.4.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.4.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.4.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,486,987.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,486,987.50

6.4.4.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-22,103,067.70
股票投资	-42,748,603.30
债券投资	20,645,535.60
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	-22,103,067.70

6.4.4.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	720,573.82
-	-
合计	720,573.82

注：

本基金在保本周期到期前赎回费率随申请份额持有时间增加而递减，赎回费归入基金资产的比例不得低于50%。

6.4.4.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	653,107.15
银行间市场交易费用	2,950.00
-	-
合计	656,057.15

6.4.4.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,767.52
账户维护费	18,960.00
银行费用	10,152.24
合计	227,468.33

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
兴业证券	26,658,236.85	5.89	74,269,629.68	15.53
华泰证券	4,594,278.20	1.02	0.00	0.00

6.4.7.1.2 债券交易

注:无。

6.4.7.1.3 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		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 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 (%)
华泰证券	196,200,000.00	2.19	0.00	0.00

6.4.7.1.4 权证交易

注:无。

6.4.7.1.5 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	4,186.87	1.02	4,186.87	2.04
兴业证券	24,293.53	5.89	24,293.53	11.83
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
兴业证券	67,682.12	15.43	67,682.12	16.56
华泰证券	0.00	0.00	0.00	0.00

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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,008,842.22	18,068,572.49
其中：支付销售机构的客户维护费	2,371,209.24	2,883,954.22

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1.30%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 1.30% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,462,898.86	2,779,780.37

注：支付基金托管人中国建设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。

6.4.7.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	7,001,143.85	56,949.71	4,608,440.03	54,205.21

注：本基金由基金托管人中国建设银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 利润分配情况

注：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**

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
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
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	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

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,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192,000,000.00元,其中GC003余额为1,000,000.00,于2018年7月2日到期;其中GC007余额为191,000,000.00;于2018年7月4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。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 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，将风险控制可在承受的范围之内。

6.4.10.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行；定期存款存放在具有基金托管资格的中国民生银行股份有限公司和上海浦东发展银行股份有限公司，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83.18%(2017年12月31日：80.43%)。

6.4.10.3 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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大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，因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于2018年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有192,000,000.00元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

6.4.10.3.1 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例

进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.9。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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年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	107,001,143.85	-	-	-	107,001,143.85
结算备付金	7,788,439.94	-	-	-	7,788,439.94
存出保证金	69,171.00	-	-	-	69,171.00
交易性金融资产	1,931,679,897.42	212,710,615.00	-	315,963,281.06	2,460,353,793.48
买入返售金融资产	4,200,000.00	-	-	-	4,200,000.00
应收利息	-	-	-	42,997,571.09	42,997,571.09
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,050,738,652.21	212,710,615.00	-	358,960,852.15	2,622,410,119.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,607,044.48	2,607,044.48
应付托管费	-	-	-	401,083.79	401,083.79
应付证券清算款	-	-	-	5,055,892.10	5,055,892.10
卖出回购金融资产款	192,000,000.00	-	-	-	192,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	207,040.02	207,040.02
应付利息	-	-	-	99,460.26	99,460.26
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	91,652.26	91,652.26
其他负债	-	-	-	198,356.09	198,356.09
负债总计	192,000,000.00	-	-	8,660,529.00	200,660,529.00

	0.00			0	
利率敏感度缺口	1,858,738,652.21	212,710,615.00	-	350,300,323.15	2,421,749,590.36
上年度末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	143,355,386.94	-	-	-	143,355,386.94
结算备付金	6,669,816.48	-	-	-	6,669,816.48
存出保证金	44,877.30	-	-	-	44,877.30
交易性金融资产	1,566,311,247.60	622,280,270.30	978,200.74	292,011,621.47	2,481,581,340.11
买入返售金融资产	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应收利息	-	-	-	47,491,424.85	47,491,424.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	2,646,140.62	2,646,140.62
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,718,381,328.32	622,280,270.30	978,200.74	342,149,186.94	2,683,788,986.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,823,339.44	2,823,339.44
应付托管费	-	-	-	434,359.91	434,359.91
应付证券清算款	-	-	-	1,584,228.30	1,584,228.30
卖出回购金融资产款	131,000,000.00	-	-	-	131,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	169,419.11	169,419.11
应付利息	-	-	-	169,279.88	169,279.88
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	391,000.00	391,000.00
负债总计	131,000,000.00	-	-	5,571,626.64	136,571,626.64
利率敏感度缺口	1,587,381,328.32	622,280,270.30	978,200.74	336,577,560.30	2,547,217,359.66

注:表中所示为本基金资产及负债的公允价值,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。

6.4.10.4.1.2 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 (2018年6月30日)	上年度末 (2017年12月31日)
分析	1.市场利率下降25个基点	2,619,567.37	4,275,382.06
	2.市场利率上升25个基点	-2,619,475.67	-4,253,475.26

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.4.3 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固定收益类资产(包括各类债券、银行存款、货币市场工具等)和权益类资产(股票、股指期货、权证等)的投资比例进行动态调整。本基金投资组合中权益类资产占基金资产的比例不高于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。

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例（ %）	公允价值	占基金资产 净值比例（ %）
交易性金融资产-股票投资	315,963,281.06	13.05	292,011,621.47	11.46
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	315,963,281.06	13.05	292,011,621.47	11.46

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末 (2018年6月30日)	上年度末 (2017年12月31日)	
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13.

05%(2017年12月31日：7.61%)，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)。

6.4.11 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	315,963,281.06	12.05
	其中：股票	315,963,281.06	12.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,144,390,512.42	81.77
	其中：债券	2,144,390,512.42	81.77
	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	4,200,000.00	0.16
	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	114,789,583.79	4.38
-	-	-	-
8	其他各项资产	43,066,742.09	1.64
9	合计	2,622,410,119.36	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	175,143,547.25	7.23

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,038,295.85	0.08
E	建筑业	9,253,523.09	0.38
F	批发和零售业	31,454,116.22	1.30
G	交通运输、仓储和邮政业	16,585,519.56	0.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	77,387,652.95	3.20
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,019,400.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.00
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	315,963,281.06	13.05

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	2,102,100	30,270,240.00	1.25
2	601009	南京银行	2,471,850	19,107,400.50	0.79
3	000786	北新建材	900,105	16,678,945.65	0.69
4	601229	上海银行	835,300	13,164,328.00	0.54
5	000651	格力电器	263,052	12,402,901.8	0.51

				0	
6	002511	中顺洁柔	1,284,935	12,104,087.70	0.50
7	000333	美的集团	218,166	11,392,628.52	0.47
8	600056	中国医药	550,978	10,066,368.06	0.42
9	600511	国药股份	363,800	9,804,410.00	0.40
10	600741	华域汽车	397,600	9,431,072.00	0.39
11	603328	依顿电子	860,200	9,333,170.00	0.39
12	600068	葛洲坝	1,283,429	9,253,523.09	0.38
13	601818	光大银行	2,504,400	9,166,104.00	0.38
14	600519	贵州茅台	12,000	8,777,520.00	0.36
15	601966	玲珑轮胎	500,596	7,894,398.92	0.33
16	600887	伊利股份	280,000	7,812,000.00	0.32
17	600690	青岛海尔	400,100	7,705,926.00	0.32
18	600176	中国巨石	750,516	7,677,778.68	0.32
19	603368	柳药股份	225,769	7,626,476.82	0.31
20	603885	吉祥航空	480,740	7,408,203.40	0.31
21	002462	嘉事堂	335,501	6,508,719.40	0.27
22	002304	洋河股份	42,500	5,593,000.00	0.23
23	000895	双汇发展	210,771	5,566,462.11	0.23
24	601607	上海医药	230,900	5,518,510.00	0.23
25	601169	北京银行	836,215	5,042,376.45	0.21
26	600066	宇通客车	220,200	4,225,638.00	0.17
27	002027	分众传媒	420,000	4,019,400.00	0.17
28	600062	华润双鹤	160,000	3,928,000.00	0.16
29	000910	大亚圣象	219,517	3,709,837.30	0.15
30	603228	景旺电子	64,100	3,169,104.00	0.13
31	601137	博威合金	380,500	3,074,440.00	0.13
32	000089	深圳机场	400,000	3,060,000.00	0.13
33	000999	华润三九	109,424	3,045,269.92	0.13
34	002597	金禾实业	150,000	3,042,000.00	0.13
35	600004	白云机场	229,905	3,009,456.45	0.12
36	002117	东港股份	200,000	2,966,000.00	0.12
37	002236	大华股份	130,000	2,931,500.00	0.12
38	000568	泸州老窖	44,500	2,708,270.00	0.11
39	000915	山大华特	108,300	2,177,913.00	0.09
40	600674	川投能源	231,100	2,015,192.00	0.08
41	000028	国药一致	40,000	1,996,000.00	0.08
42	601006	大秦铁路	207,751	1,705,635.71	0.07
43	002661	克明面业	110,424	1,424,469.60	0.06

44	600270	外运发展	66,900	1,402,224.00	0.06
45	300463	迈克生物	51,800	1,291,374.00	0.05
46	600114	东睦股份	129,925	1,269,367.25	0.05
47	300628	亿联网络	15,000	988,650.00	0.04
48	002508	老板电器	30,000	918,600.00	0.04
49	600036	招商银行	24,100	637,204.00	0.03
50	000887	中鼎股份	30,000	432,300.00	0.02
51	002472	双环传动	50,000	428,500.00	0.02
52	603518	维格娜丝	20,000	393,800.00	0.02
53	002705	新宝股份	40,000	390,800.00	0.02
54	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.01
55	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.00
56	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
57	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
58	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	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	19,019,142.00	0.75
2	601229	上海银行	16,718,993.61	0.66
3	600056	中国医药	11,840,524.15	0.46
4	601818	光大银行	10,918,389.00	0.43
5	000786	北新建材	9,861,418.30	0.39
6	601966	玲珑轮胎	9,043,320.17	0.36
7	600519	贵州茅台	8,161,002.00	0.32
8	600887	伊利股份	8,001,893.00	0.31
9	002462	嘉事堂	7,670,033.64	0.30
10	600690	青岛海尔	7,078,496.78	0.28
11	600703	三安光电	5,902,792.85	0.23
12	601009	南京银行	5,679,352.60	0.22
13	002027	分众传媒	5,422,144.65	0.21
14	601607	上海医药	5,421,011.20	0.21
15	000651	格力电器	5,335,657.49	0.21
16	600030	中信证券	5,134,859.00	0.20
17	603368	柳药股份	4,920,667.80	0.19

18	000910	大亚圣象	4,620,791.00	0.18
19	603328	依顿电子	4,564,311.01	0.18
20	600062	华润双鹤	3,816,710.00	0.15

注:买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601009	南京银行	7,773,823.25	0.31
2	002242	九阳股份	7,466,436.75	0.29
3	603368	柳药股份	6,628,604.03	0.26
4	000333	美的集团	5,810,209.99	0.23
5	002563	森马服饰	5,718,496.00	0.22
6	601169	北京银行	5,535,624.00	0.22
7	002511	中顺洁柔	5,475,826.70	0.21
8	000910	大亚圣象	5,423,904.32	0.21
9	600703	三安光电	4,988,453.00	0.20
10	600030	中信证券	4,961,424.00	0.19
11	600741	华域汽车	3,985,917.45	0.16
12	002142	宁波银行	3,913,669.02	0.15
13	601229	上海银行	3,829,671.96	0.15
14	601098	中南传媒	3,569,046.76	0.14
15	000423	东阿阿胶	3,371,729.00	0.13
16	601398	工商银行	3,312,877.00	0.13
17	601318	中国平安	3,282,228.00	0.13
18	002304	洋河股份	3,278,748.00	0.13
19	300571	平治信息	3,149,451.00	0.12
20	603056	德邦股份	3,029,579.32	0.12

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	253,395,745.45
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	200,800,968.28
--------------	----------------

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	201,482,391.20	8.32
	其中：政策性金融债	129,866,000.00	5.36
4	企业债券	557,606,520.80	23.02
5	企业短期融资券	120,817,000.00	4.99
6	中期票据	420,446,000.00	17.36
7	可转债（可交换债）	1,775,600.42	0.07
8	同业存单	842,263,000.00	34.78
9	其他	-	-
10	合计	2,144,390,512.42	88.55

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	111812126	18北京银行CD126	2,000,000	196,040,000.00	8.09
2	101551100	15联通MTN003	1,300,000	130,026,000.00	5.37
3	170207	17国开07	1,100,000	110,000,000.00	4.54
4	111892726	18宁波银行CD045	1,000,000	96,730,000.00	3.99
5	111714244	17江苏银行CD244	1,000,000	95,650,000.00	3.95

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

本基金投资的前十名证券的发行主体除18宁波银行CD04 (111892726 CY)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。

根据宁波银监局2017年10月27日《宁波银监局行政处罚信息公开表》, 宁波银监局因以贷转存等违法违规事实对宁波银行进行行政处罚, 罚款人民币50万元。根据宁波银监局2018年6月7日《宁波银监局行政处罚信息公开表》, 宁波银监局因以不正当手段违规吸收存款对宁波银行进行行政处罚, 罚款人民币60万。

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

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	69,171.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	42,997,571.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,066,742.09

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110040	生益转债	222,018.80	0.01

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 (%)
9,900	226,236.51	1,071,686,590.91	47.85	1,168,054,885.10	52.15

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	661,382.92	0.0295

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（2016年1月11日） 基金份额总额	2,985,910,097.72
本报告期期初基金份额总额	2,372,687,736.22
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	132,946,260.21
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	2,239,741,476.01

§10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内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	
国金证券	1	102,138,706.87	22.58%	93,053.50	22.58%	-
民族证券	1	85,657,861.69	18.94%	78,030.81	18.93%	-
中泰证券	1	75,489,332.92	16.69%	68,793.31	16.69%	-
招商证券	1	43,806,593.24	9.69%	39,921.58	9.69%	-
银河证券	1	39,675,993.31	8.77%	36,156.23	8.77%	-
国泰君安	1	33,653,	7.44%	30,668.50	7.44%	-

		556.25				
安信证券	1	29,241,853.57	6.47%	26,648.85	6.47%	-
兴业证券	1	26,658,236.85	5.89%	24,293.53	5.89%	-
中金公司	1	8,844,894.69	1.96%	8,060.19	1.96%	-
华泰证券	1	4,594,278.20	1.02%	4,186.87	1.02%	-
川财证券	1	2,548,796.83	0.56%	2,322.62	0.56%	-
天源证券	1	-	-	-	-	--
宏信证券	1	-	-	-	-	--
第一创业	1	-	-	-	-	--
银泰证券	1	-	-	-	-	--
诚浩证券	1	-	-	-	-	--
宏源证券	1	-	-	-	-	--

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

A: 选择标准

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

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

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有

关专题提供研究报告和讲座；

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	1,645,000,000.00	18.37%	-	-
诚浩证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	3,000,000.00	0.03%	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
国金证券	16,567,150.00	95.79%	3,925,000,000.00	43.82%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	196,200,000.00	2.19%	-	-
民族证券	728,455.60	4.21%	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	772,000,000.00	8.62%	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	2,415,100,000.00	26.97%	-	-

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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月05日

	司旗下基金的公告		
2	南方益和保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2018年第1号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年02月13日
3	南方益和保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2018年第1号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年02月13日
4	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
5	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

§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	667,321,760.00	-	-	667,321,760.00	29.79
个人	-	-	-	-	-	-	-
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益和保本混合型证券投资基金的文件。
- 2、南方益和保本混合型证券投资基金基金合同。
- 3、南方益和保本混合型证券投资基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 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>

南方基金管理股份有限公司

2018年08月27日