

南方稳健成长贰号证券投资基金 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：中国工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。

基金托管人中国工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

§ 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	5
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.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§ 4 管理人报告	8
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.....	9
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
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	10
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
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
§ 7 投资组合报告	32
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.....	32
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.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
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.....	38

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.....	38
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.....	39
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12	投资组合报告附注.....	39
§ 8	基金份额持有人信息.....	39
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.....	40
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.....	40
§ 9	开放式基金份额变动.....	40
§ 10	重大事件揭示.....	40
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.....	41
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.....	41
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8	其他重大事件.....	43
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	44
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.....	44
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	44
§ 12	备查文件目录.....	44
12.1	备查文件目录.....	44
12.2	存放地点.....	44
12.3	查阅方式.....	44

基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方稳健成长贰号证券投资基金
基金简称	南方稳健成长贰号混合
基金主代码	202002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 7 月 25 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,745,535,903.75 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“南稳贰号”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为稳健成长型基金,在控制投资风险并保持基金投资组合良好的流动性的前提下,力求使该为投资者提供稳健和长期稳定的资本利得。
投资策略	在股票投资方面,本基金根据上市公司的获利能力和成长潜力,主要可以区分为价值型股票和成长型股票。本基金明确界定了价值型和成长型股票的特征,并依据该特征分别构造一个投资组合。本基金投资于这两个组合内股票的比例不低于股票投资部分的 80%。
业绩比较基准	上证综合指数×80%+上证国债指数×20%。
风险收益特征	本基金为混合基金,属证券投资基金中的风险收益适中的品种。

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	中国工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	95588
传真	0755-82763889	010-66105799
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	张海波	易会满

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

§ 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	-3,480,949.86
本期利润	-123,834,398.48
加权平均基金份额本期利润	-0.0325
本期加权平均净值利润率	-6.79%
本期基金份额净值增长率	-6.92%
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	-74,739,147.55
期末可供分配基金份额利润	-0.0200
期末基金资产净值	1,687,616,504.30
期末基金份额净值	0.4506
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	171.33%

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

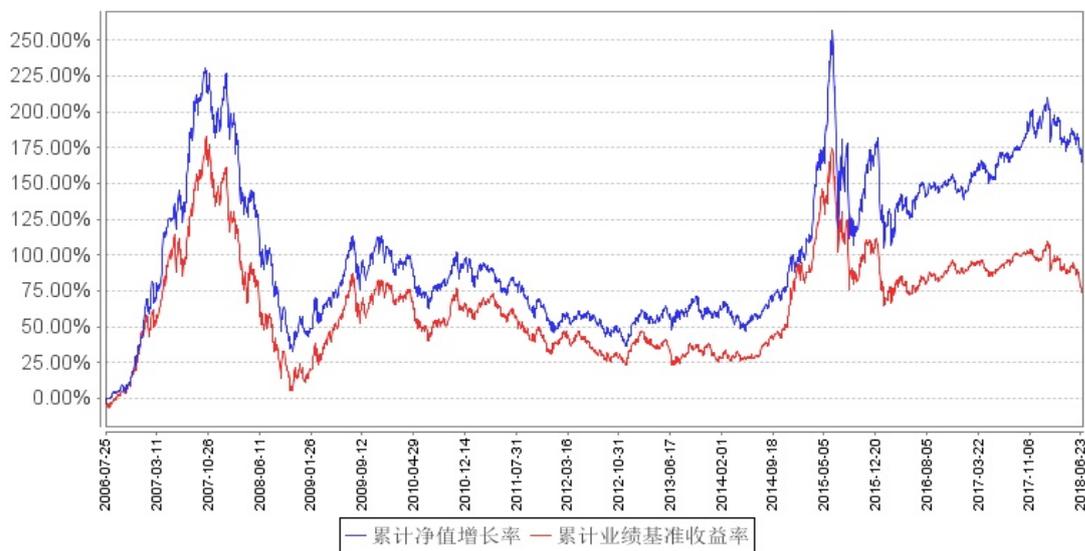
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.92%	1.08%	-6.36%	0.93%	2.44%	0.15%
过去三个月	-3.82%	0.92%	-7.87%	0.84%	4.05%	0.08%
过去六个月	-6.92%	1.01%	-10.68%	0.87%	3.76%	0.14%
过去一年	0.23%	0.89%	-8.04%	0.68%	8.27%	0.21%
过去三年	-2.38%	1.46%	-25.36%	1.17%	22.98%	0.29%
自基金合同生效起至今	171.33%	1.39%	76.70%	1.34%	94.63%	0.05%

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

南方稳健成长贰号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		
应帅	本基金基金经理	2012 年 11 月 23 日	-	16	北大光华管理学院管理学硕士，具有基金从业资格。曾担任长城基金管理公司行业研究员，2007 年加入南方基金，2007 年 5 月至 2009 年 2 月，任南方宝元基金经理；2007 年 5 月至 2012 年 11 月，任南方成份基金经理；2010 年 12 月至 2016 年 3 月，任南方宝元基金经理；2012 年 11 月至今，任南方稳健基金经理；2012 年 11 月至今，任南稳贰号基金经理；2016 年 3 月至今，任南方驱动基金经理；2017 年 8 月至今，任南方智造股票基金经理。

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《南方稳健成长贰号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

进入2018年股市运行模式和轨迹均发生了较大的变化，一季度市场波动加大，创业板指数出现较大幅度反弹，但中小市值个股普遍暴跌，蓝筹股分化调整。但到了二季度，市场整体出现了较大幅度的调整，尤其是创业板和中小市值个股，蓝筹股则普遍较为稳定。宏观经济方面，国内经济继续平稳发展，但中美贸易争端给经济复兴蒙上了阴影；国内政策方面，去杠杆和房地产调控比较坚决。本基金今年以来仓位持续下行，在新能源、半导体、工业互联网板块方面波段操作，降低了通讯、周期、家电和白酒的配置，增加了医药配置。目前本基金主要的投资方向依然集中在白酒、银行、家电。本基金将继续采取自下而上的选股策略，以价值投资为理念，争取获得较好的绝对收益。

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-6.92%，业绩比较基准收益率为-10.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年国内货币政策比较严厉，而随着宏观经济以及中美贸易争端不确定性的增加，政策方面发生了微调，定向降准以及财政政策加大主动，我们预期宏观经济将平稳运行。上半年市场总体调整，幅度虽然不大，但不少个股却出现了较为明显的暴跌；我们认为市场风险已经大部分释放，随着宏观经济的走稳，市场底部将会显现。行业板块方面，我们还是倾向于消费医疗稳健型行业以及低估值的银行板块。

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，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 90%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利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；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；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。本报告期内 2018 年 1 月 16 日分配数（每 10 份基金份额派发红利 0.14 元）为以往年度收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方稳健成长贰号证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，南方稳健成长贰号证券投资基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方稳健成长贰号证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方稳健成长贰号证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 53,473,401.94 元。

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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方稳健成长贰号证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方稳健成长贰号证券投资基金

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	6.4.7.1	187,197,930.13	43,015,707.29
结算备付金		3,358,906.08	2,986,323.89
存出保证金		576,546.46	626,719.38
交易性金融资产	6.4.7.2	1,491,425,339.23	1,864,571,066.24
其中：股票投资		1,109,414,620.23	1,459,252,206.84
基金投资		-	-
债券投资		382,010,719.00	405,318,859.40
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	-	-
应收证券清算款		-	32,622,920.85
应收利息	6.4.7.5	9,873,351.21	5,234,151.66
应收股利		20,000.00	20,000.00
应收申购款		163,018.84	151,703.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,692,615,091.95	1,949,228,592.47
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	6,454,427.35
应付赎回款		705,825.68	1,726,096.76
应付管理人报酬		2,129,296.94	2,461,816.59
应付托管费		354,882.81	410,302.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,610,057.98	1,512,266.53
应交税费		9.07	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	198,515.17	401,485.49
负债合计		4,998,587.65	12,966,395.54
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,762,355,651.85	1,831,377,530.34
未分配利润	6.4.7.10	-74,739,147.55	104,884,666.59
所有者权益合计		1,687,616,504.30	1,936,262,196.93
负债和所有者权益总计		1,692,615,091.95	1,949,228,592.47

注: 报告截止日 2018 年 6 月 30 日, 基金份额净值 0.4506 元, 基金份额总额 3,745,535,903.75 份。

6.2 利润表

会计主体: 南方稳健成长贰号证券投资基金

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	上年度可比期间 2017年1月1日至
-----	-----	------------------	-----------------------

		2018 年 6 月 30 日	2017 年 6 月 30 日
一、收入		-102,429,232.14	214,175,955.57
1. 利息收入		8,119,377.88	8,304,684.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	421,949.61	641,425.43
债券利息收入		7,510,955.04	7,302,804.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		186,473.23	360,454.61
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,631,642.96	84,534,736.85
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,827,254.26	75,984,746.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	95,389.88	17,000.00
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	7,708,998.82	8,532,989.89
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-120,353,448.62	121,200,954.77
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	173,195.64	135,579.74
减：二、费用		21,405,166.34	23,430,661.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,555,699.52	13,914,452.54
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,259,283.18	2,319,075.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,375,036.42	6,974,745.64
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.97	-
7. 其他费用	6.4.7.20	215,146.25	222,388.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-123,834,398.48	190,745,293.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-123,834,398.48	190,745,293.81

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方稳健成长贰号证券投资基金

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）	1,831,377,530.34	104,884,666.59	1,936,262,196.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-123,834,398.48	-123,834,398.48
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）	-69,021,878.49	-2,316,013.72	-71,337,892.21
其中：1. 基金申购款	63,522,306.40	3,246,854.96	66,769,161.36
2. 基金赎回款	-132,544,184.89	-5,562,868.68	-138,107,053.57
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）	-	-53,473,401.94	-53,473,401.94
五、期末所有者权益（基金净值）	1,762,355,651.85	-74,739,147.55	1,687,616,504.30
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）	2,058,453,106.65	-231,768,685.23	1,826,684,421.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	190,745,293.81	190,745,293.81
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）	-86,514,525.55	5,370,708.51	-81,143,817.04
其中：1. 基金申购款	29,328,791.73	-2,021,426.78	27,307,364.95
2. 基金赎回款	-115,843,317.28	7,392,135.29	-108,451,181.99
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）	1,971,938,581.10	-35,652,682.91	1,936,285,898.19

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

南方稳健成长贰号证券投资基金(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”)证监基金字[2006]第116号《关于同意南方稳健成长贰号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《南方稳健成长贰号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 5,256,725,210.10 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(2006)第 116 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方稳健成长贰号证券投资基金基金合同》于 2006 年 7 月 25 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 5,257,868,688.68 份基金份额, 其中认购资金利息折合 1,143,478.58 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《南方稳健成长贰号证券投资基金招募说明书》和《南方稳健成长贰号证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定, 本基金于 2007 年 4 月 9 日进行了基金份额拆分, 拆分比例为 1:2.125288343, 并于 2007 年 4 月 9 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《南方稳健成长贰号证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具, 主要投资对象为业绩优良并能稳定增长的上市公司的股票和具有较大成长潜力的上市公司的股票。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%, 投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。本基金的业绩比较基准为: 上证综合指数 \times 80%+上证国债指数 \times 20%。

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》、《南方稳健成长贰号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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	187,197,930.13
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	187,197,930.13

6.4.7.2 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	1,011,943,007.72	1,109,414,620.23	97,471,612.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	49,917,771.86	49,963,719.00
	银行间市场	333,161,860.00	332,047,000.00
	合计	383,079,631.86	382,010,719.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,395,022,639.58	1,491,425,339.23	96,402,699.65

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

注:无。

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 2018年6月30日
应收活期存款利息	34,944.44
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	1,360.35
应收债券利息	9,836,812.96
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	233.46
合计	9,873,351.21

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 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,610,057.98
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,610,057.98

6.4.7.8 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	2,638.78

预提费用	195,876.39
合计	198,515.17

6.4.7.9 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	3,892,221,807.71	1,831,377,530.34
本期申购	135,007,892.62	63,522,306.40
本期赎回（以“-”号填列）	-281,693,796.58	-132,544,184.89
- 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	3,745,535,903.75	1,762,355,651.85

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	60,013,885.81	44,870,780.78	104,884,666.59
本期利润	-3,480,949.86	-120,353,448.62	-123,834,398.48
本期基金份额交易产生的变动数	-1,831,693.57	-484,320.15	-2,316,013.72
其中：基金申购款	706,969.73	2,539,885.23	3,246,854.96
基金赎回款	-2,538,663.30	-3,024,205.38	-5,562,868.68
本期已分配利润	-53,473,401.94	-	-53,473,401.94
本期末	1,227,840.44	-75,966,987.99	-74,739,147.55

6.4.7.11 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	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	25,221.77
其他	4,556.38
合计	421,949.61

6.4.7.12 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	1,867,799,849.18
减：卖出股票成本总额	1,865,972,594.92
买卖股票差价收入	1,827,254.26

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 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
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	95,389.88
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	95,389.88

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	74,597,829.75
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	72,456,797.89
减：应收利息总额	2,045,641.98
买卖债券差价收入	95,389.88

6.4.7.13.3 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
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,708,998.82
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,708,998.82

6.4.7.17 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	-120,353,448.62
股票投资	-125,111,207.11
债券投资	4,757,758.49
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	-120,353,448.62

6.4.7.18 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	169,543.15
补差费归资产	3,652.49
合计	173,195.64

注：1、本基金的赎回费率为赎回金额的 0.5%，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中赎回费部分的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 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	5,375,036.42

银行间市场交易费用	-
合计	5,375,036.42

6.4.7.20 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	47,108.87
信息披露费	148,767.52
账户维护费	18,600.00
银行费用	669.86
合计	215,146.25

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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。

6.4.10 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 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	328,905,041.17	9.38	0.00	0.00
兴业证券	44,896,867.93	1.28	0.00	0.00

6.4.10.1.2 债券交易

注:无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注:无。

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 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	299,733.12	9.38	194,050.15	12.05
兴业证券	40,914.50	1.28	40,914.50	2.54
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 (%)

-	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、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。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 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	13,555,699.52	13,914,452.54
其中:支付销售机构的客户维护费	1,640,077.66	1,676,368.76

注:支付基金管理人南方基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%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 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 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	2,259,283.18	2,319,075.41

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 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 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
中国工商银行股份有限公司	187,197,930.13	392,171.46	87,876,271.83	596,555.61

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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

单位:人民币元

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2018年01月15日	2018-01-16	2018-01-16	0.1400	21,723,979.75	31,749,422.19	53,473,401.94	-
合计	-	-	-	0.1400	21,723,979.75	31,749,422.19	53,473,401.94	-

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
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	-

6.4.12.2 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
300072	三聚环保	2018-06-19	重大事项	23.28	2018-07-10	24.00	47	1,553.27	1,094.16	-
600745	闻泰科技	2018-04-17	重大事项	25.55	-	-	58	1,674.87	1,481.90	-
603939	益丰药房	2018-04-17	重大事项	59.72	2018-07-16	65.69	312,193	19,085,304.20	18,644,165.96	-

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

本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。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相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估

测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

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中国工商银行，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。

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

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。

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

6.4.13.4.1.1 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	187,197,930.13	-	-	-	187,197,930.13
结算备付金	3,358,906.08	-	-	-	3,358,906.08
存出保证金	576,546.46	-	-	-	576,546.46
交易性金融资产	215,864,079.00	145,322,640.00	20,824,000.00	1,109,414,620.23	1,491,425,339.23
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	9,873,351.21	9,873,351.21
应收股利	-	-	-	20,000.00	20,000.00
应收申购款	55,310.73	-	-	107,708.11	163,018.84
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	407,052,772.40	145,322,640.00	20,824,000.00	1,119,415,679.55	1,692,615,091.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	705,825.68	705,825.68
应付管理人报酬	-	-	-	2,129,296.94	2,129,296.94
应付托管费	-	-	-	354,882.81	354,882.81

应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,610,057.98	1,610,057.98
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	9.07	9.07
其他负债	-	-	-	198,515.17	198,515.17
负债总计	-	-	-	4,998,587.65	4,998,587.65
利率敏感度缺口	407,052,772.40	145,322,640.00	20,824,000.00	1,114,417,091.90	1,687,616,504.30
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	43,015,707.29	-	-	-	43,015,707.29
结算备付金	2,986,323.89	-	-	-	2,986,323.89
存出保证金	626,719.38	-	-	-	626,719.38
交易性金融资产	245,834,805.40	123,575,454.00	35,908,600.00	1,459,252,206.84	1,864,571,066.24
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	5,234,151.66	5,234,151.66
应收股利	-	-	-	20,000.00	20,000.00
应收申购款	3,961.72	-	-	147,741.44	151,703.16
应收证券清算款	-	-	-	32,622,920.85	32,622,920.85
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	292,467,517.68	123,575,454.00	35,908,600.00	1,497,277,020.79	1,949,228,592.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,726,096.76	1,726,096.76
应付管理人报酬	-	-	-	2,461,816.59	2,461,816.59
应付托管费	-	-	-	410,302.82	410,302.82
应付证券清算款	-	-	-	6,454,427.35	6,454,427.35
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应付交易费用	-	-	-	1,512,266.53	1,512,266.53
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	401,485.49	401,485.49
负债总计	-	-	-	12,966,395.54	12,966,395.54
利率敏感度缺口	292,467,517.68	123,575,454.00	35,908,600.00	1,484,310,625.25	1,936,262,196.93

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 （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	1,061,483.72	1,355,780.74
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,061,397.45	-1,344,555.30

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。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。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 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	1,109,414,620.23	65.74	1,459,252,206.84	75.36
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	1,109,414,620.23	65.74	1,459,252,206.84	75.36

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末 (2018 年 6 月 30 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)	
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	61,174,176.10	91,333,971.89
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-61,174,176.10	-91,333,971.89

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	1,109,414,620.23	65.54
	其中：股票	1,109,414,620.23	65.54
2	基金投资	0.00	0.00
3	固定收益投资	382,010,719.00	22.57
	其中：债券	382,010,719.00	22.57
	资产支持证券	0.00	0.00
4	贵金属投资	0.00	0.00
5	金融衍生品投资	0.00	0.00
6	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	190,556,836.21	11.26
8	其他各项资产	10,632,916.51	0.63
	合计	1,692,615,091.95	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	776,682,007.11	46.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,074.90	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	37,811,088.67	2.24
G	交通运输、仓储和邮政业	7,690.88	0.00
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	28,983,404.51	1.72
J	金融业	207,398,788.65	12.29
K	房地产业	925.44	0.00
L	租赁和商务服务业	58,344,022.43	3.46
M	科学研究和技术服务业	79,391.50	0.00
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	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	1,109,414,620.23	65.74

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	600519	贵州茅台	183,759	134,412,358.14	7.96
2	000651	格力电器	1,885,001	88,877,797.15	5.27
3	601009	南京银行	10,698,321	82,698,021.33	4.90
4	000786	北新建材	2,838,243	52,592,642.79	3.12
5	603589	口子窖	755,303	46,413,369.35	2.75
6	601229	上海银行	2,910,035	45,862,151.60	2.72
7	300003	乐普医疗	1,230,000	45,116,400.00	2.67
8	002430	杭氧股份	2,986,568	42,797,519.44	2.54
9	600872	中炬高新	1,440,000	40,320,000.00	2.39
10	002507	涪陵榨菜	1,370,262	35,188,328.16	2.09
11	002236	大华股份	1,350,000	30,442,500.00	1.80
12	601888	中国国旅	460,083	29,633,946.03	1.76
13	601318	中国平安	500,000	29,290,000.00	1.74
14	603686	龙马环卫	1,190,000	29,083,600.00	1.72
15	300571	平治信息	424,869	28,976,065.80	1.72
16	002027	分众传媒	3,000,000	28,710,000.00	1.70
17	002503	搜于特	7,943,000	27,800,500.00	1.65
18	000333	美的集团	515,950	26,942,909.00	1.60
19	600036	招商银行	900,000	23,796,000.00	1.41
20	300373	扬杰科技	820,000	23,452,000.00	1.39
21	000596	古井贡酒	237,500	21,085,250.00	1.25
22	603233	大参林	279,934	19,164,281.64	1.14
23	603939	益丰药房	312,193	18,644,165.96	1.10
24	600703	三安光电	900,013	17,298,249.86	1.03
25	600176	中国巨石	1,431,998	14,649,339.54	0.87
26	601288	农业银行	4,000,000	13,760,000.00	0.82
27	002396	星网锐捷	625,860	12,811,354.20	0.76

28	000568	泸州老窖	207,100	12,604,106.00	0.75
29	601939	建设银行	1,800,000	11,790,000.00	0.70
30	002212	南洋股份	987,900	11,746,131.00	0.70
31	300642	透景生命	192,500	11,492,250.00	0.68
32	300463	迈克生物	400,000	9,972,000.00	0.59
33	603387	基蛋生物	184,887	9,388,561.86	0.56
34	002491	通鼎互联	835,900	9,253,413.00	0.55
35	002262	恩华药业	400,000	8,004,000.00	0.47
36	600066	宇通客车	370,000	7,100,300.00	0.42
37	002511	中顺洁柔	618,070	5,822,219.40	0.34
38	002859	洁美科技	16,665	649,101.75	0.04
39	603823	百合花	36,764	572,415.48	0.03
40	002860	星帅尔	11,970	249,694.20	0.01
41	601066	中信建投	18,690	201,104.40	0.01
42	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.01
43	300745	欣锐科技	1,304	107,032.32	0.01
44	603587	地素时尚	2,442	100,879.02	0.01
45	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.00
46	300746	汉嘉设计	2,318	79,391.50	0.00
47	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
48	603045	福达合金	891	43,427.34	0.00
49	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
50	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00
51	000858	五粮液	83	6,308.00	0.00
52	603773	沃格光电	81	5,913.00	0.00
53	300628	亿联网络	78	5,140.98	0.00
54	002931	锋龙股份	95	4,740.50	0.00
55	603799	华友钴业	47	4,581.09	0.00
56	002916	深南电路	68	4,318.68	0.00
57	603301	振德医疗	66	3,251.82	0.00
58	603897	长城科技	95	3,189.15	0.00
59	002927	泰永长征	79	3,021.75	0.00
60	603080	新疆火炬	87	2,971.05	0.00
61	002930	宏川智慧	67	2,957.38	0.00
62	002925	盈趣科技	52	2,879.76	0.00
63	300739	明阳电路	93	2,737.92	0.00
64	002915	中欣氟材	85	2,715.75	0.00
65	603486	科沃斯	39	2,506.53	0.00
66	300504	天邑股份	62	2,444.66	0.00
67	300634	彩讯股份	58	2,370.46	0.00
68	603013	亚普股份	73	2,363.74	0.00
69	603329	上海雅仕	82	2,343.56	0.00

70	002929	润建通信	52	2,106.00	0.00
71	300684	中石科技	27	2,099.79	0.00
72	002920	德赛西威	69	2,063.10	0.00
73	002923	润都股份	65	1,983.15	0.00
74	002821	凯莱英	21	1,831.83	0.00
75	300733	西菱动力	93	1,824.66	0.00
76	603516	淳中科技	53	1,824.26	0.00
77	002222	福晶科技	139	1,812.56	0.00
78	603655	朗博科技	80	1,758.40	0.00
79	603156	养元饮品	27	1,675.62	0.00
80	600511	国药股份	61	1,643.95	0.00
81	603898	好莱客	61	1,600.64	0.00
82	002460	赣锋锂业	39	1,504.62	0.00
83	600929	湖南盐业	96	1,496.64	0.00
84	600745	闻泰科技	58	1,481.90	0.00
85	603056	德邦股份	46	1,259.94	0.00
86	300735	光弘科技	64	1,219.84	0.00
87	002439	启明星辰	55	1,167.10	0.00
88	600867	通化东宝	48	1,150.56	0.00
89	603369	今世缘	50	1,141.50	0.00
90	002074	国轩高科	81	1,138.86	0.00
91	002928	华夏航空	40	1,130.00	0.00
92	000636	风华高科	71	1,127.48	0.00
93	300072	三聚环保	47	1,094.16	0.00
94	603596	伯特利	32	1,088.64	0.00
95	002922	伊戈尔	45	1,084.50	0.00
96	000063	中兴通讯	80	1,042.40	0.00
97	300730	科创信息	35	1,027.95	0.00
98	603733	仙鹤股份	38	1,012.32	0.00
99	603214	爱婴室	19	997.12	0.00
100	300741	华宝股份	25	994.50	0.00
101	300323	华灿光电	75	969.00	0.00
102	603477	振静股份	55	953.15	0.00
103	000537	广宇发展	96	925.44	0.00
104	601838	成都银行	99	866.25	0.00
105	603161	科华控股	39	845.91	0.00
106	603356	华菱精工	39	818.22	0.00
107	002583	海能达	90	751.50	0.00
108	002919	名臣健康	21	724.29	0.00
109	603876	鼎胜新材	23	690.46	0.00
110	300316	晶盛机电	50	664.50	0.00
111	600741	华域汽车	27	640.44	0.00

112	603712	七一二	22	623.48	0.00
113	603328	依顿电子	44	477.40	0.00
114	002926	华西证券	44	441.76	0.00
115	300454	深信服	4	439.84	0.00
116	603348	文灿股份	11	406.12	0.00
117	300737	科顺股份	33	393.03	0.00
118	002202	金风科技	26	328.64	0.00
119	600525	长园集团	24	253.68	0.00
120	300170	汉得信息	14	227.36	0.00
121	600030	中信证券	9	149.13	0.00
122	002192	融捷股份	5	121.25	0.00
123	600690	青岛海尔	4	77.04	0.00
124	601828	美凯龙	5	76.40	0.00
125	601166	兴业银行	3	43.20	0.00
126	601788	光大证券	1	10.98	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	137,638,501.66	7.11
2	601229	上海银行	84,669,111.50	4.37
3	002430	杭氧股份	49,300,046.62	2.55
4	601888	中国国旅	48,434,549.84	2.50
5	002439	启明星辰	48,116,671.62	2.49
6	601111	中国国航	42,861,969.59	2.21
7	300003	乐普医疗	42,682,118.82	2.20
8	002460	赣锋锂业	42,354,314.62	2.19
9	002074	国轩高科	41,137,272.73	2.12
10	600872	中炬高新	40,030,661.99	2.07
11	002202	金风科技	38,357,650.45	1.98
12	000938	紫光股份	37,982,549.00	1.96
13	603799	华友钴业	34,632,452.09	1.79
14	002192	融捷股份	34,473,390.15	1.78
15	601318	中国平安	33,301,742.09	1.72
16	002503	搜于特	32,663,295.93	1.69
17	002129	中环股份	31,041,120.01	1.60
18	002236	大华股份	30,884,660.32	1.60
19	300373	扬杰科技	30,526,577.70	1.58

20	002027	分众传媒	30,158,564.37	1.56
----	--------	------	---------------	------

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	136,872,639.68	7.07
2	601166	兴业银行	123,631,490.68	6.39
3	000651	格力电器	81,851,643.12	4.23
4	600585	海螺水泥	53,886,870.05	2.78
5	000063	中兴通讯	44,928,959.81	2.32
6	002217	合力泰	44,573,023.66	2.30
7	002439	启明星辰	44,397,826.87	2.29
8	002202	金风科技	43,892,868.97	2.27
9	601111	中国国航	42,312,880.71	2.19
10	300323	华灿光电	41,969,056.18	2.17
11	002074	国轩高科	39,736,419.85	2.05
12	601229	上海银行	39,097,425.64	2.02
13	000568	泸州老窖	39,001,678.08	2.01
14	002460	赣锋锂业	38,849,291.64	2.01
15	600745	闻泰科技	36,860,980.39	1.90
16	000938	紫光股份	35,900,670.08	1.85
17	603898	好莱客	33,797,327.18	1.75
18	600487	亨通光电	32,385,444.79	1.67
19	600176	中国巨石	30,926,579.56	1.60
20	600438	通威股份	30,323,469.44	1.57

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	1,641,246,215.42
卖出股票收入(成交)总额	1,867,799,849.18

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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	24,194,640.00	1.43
2	央行票据	0.00	0.00
3	金融债券	357,816,079.00	21.20
	其中：政策性金融债	357,816,079.00	21.20
4	企业债券	0.00	0.00
5	企业短期融资券	0.00	0.00
6	中期票据	0.00	0.00
7	可转债（可交换债）	0.00	0.00
8	同业存单	0.00	0.00
9	其他	0.00	0.00
10	合计	382,010,719.00	22.64

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	080220	08 国开 20	1,900,000	190,095,000.00	11.26
2	140219	14 国开 19	1,000,000	101,120,000.00	5.99
3	018005	国开 1701	250,800	25,175,304.00	1.49
4	130247	13 国开 47	200,000	20,824,000.00	1.23
5	130307	13 进出 07	200,000	20,008,000.00	1.19

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	576,546.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	20,000.00
4	应收利息	9,873,351.21
5	应收申购款	163,018.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	10,632,916.51

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
164,652	22,748.20	9,913,796.80	0.26	3,735,622,106.95	99.74

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

8.3 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（2006 年 7 月 25 日）基金份额总额	5,257,868,688.68
本报告期期初基金份额总额	3,892,221,807.71
本报告期基金总申购份额	135,007,892.62
减：本报告期基金总赎回份额	281,693,796.58
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	3,745,535,903.75

§ 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	
中金公司	1	680,677,414.02	19.41%	620,302.10	19.41%	-
华创证券	1	615,738,898.68	17.56%	561,124.77	17.56%	-
安信证券	1	531,676,512.51	15.16%	484,512.93	15.16%	-
国泰君安	1	428,412,619.68	12.22%	390,413.62	12.22%	-
华泰证券	2	328,905,041.17	9.38%	299,733.12	9.38%	-
国盛证券	1	303,130,646.56	8.64%	276,211.18	8.64%	-
恒泰证券	1	261,622,443.14	7.46%	238,416.80	7.46%	-
海通证券	2	157,966,623.23	4.50%	143,955.56	4.50%	-
国信证券	1	112,233,679.16	3.20%	102,263.74	3.20%	-
兴业证券	1	44,896,867.93	1.28%	40,914.50	1.28%	-
申万宏源	1	40,587,002.27	1.16%	36,987.40	1.16%	-
华福证券	1	1,286,978.00	0.04%	1,172.69	0.04%	-
中泰证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
银河证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
新时代证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
西南证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
华龙证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
国海证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
广发证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
中银国际	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
东北证券	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
安信证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
东北证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
广发证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国海证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国盛证券	31,359,295.00	61.62%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国泰君安	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国信证券	13,031,604.00	25.61%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
海通证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
恒泰证券	1,456,203.02	2.86%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
华创证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
华福证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
华龙证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
华泰证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%

申万宏源	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
西南证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
新时代证 券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
兴业证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
银河证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中金公司	5,047,395.90	9.92%	250,000,000.00	100.00%	0.00	0.00%
中泰证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中银国际	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	南方稳健成长贰号证券投资基金限制大额申购、定投和转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月11日
3	南方稳健成长贰号证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月12日
4	南方稳健成长贰号证券投资基金恢复大额申购、定投和转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月15日
5	南方基金关于旗下部分基金增加和耕传承为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年02月08日
6	南方稳健成长贰号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03月02日
7	南方稳健成长贰号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03月02日
8	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
9	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年03月30日
10	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年03月31日
11	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月06日
12	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
13	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
14	南方基金关于旗下部分基金增加大连网金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年04月27日
15	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示	中国证券报、上海	2018年01月06日

	性公告	证券报、证券时报	
16	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
17	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 03 月 31 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

注:无。

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稳健成长贰号证券投资基金的文件
- 2、南方稳健成长贰号证券投资基金基金合同
- 3、南方稳健成长贰号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>