

南方中小盘成长股票型证券投资基金(原
南方顺达保本混合型证券投资基金)
2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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：2019 年 03 月 27 日

重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2019 年 3 月 25 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。

南方中小盘成长股票型证券投资基金是根据原南方顺达保本混合型证券投资基金《南方顺达保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，由南方顺达保本混合型证券投资基金转型而来。

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

原南方顺达保本混合型证券投资基金本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 11 月 2 日止，南方中小盘成长股票型证券投资基金本报告期自 2018 年 11 月 3 日起至 12 月 31 日止。

基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	南方中小盘成长
基金主代码	000326
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 3 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	198,608,307.35 份
基金合同存续期	不定期

注：1. 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“南方中小盘成长”。

2. 本基金转型日期为 2018 年 11 月 3 日，该日起原南方顺达保本混合型证券投资基金正式变更为南方中小盘成长股票型证券投资基金。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	南方顺达保本混合
基金主代码	000326
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 10 月 28 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	324,584,179.37 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“南方顺达”。

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	通过对具备良好成长潜力及合理估值水平的中小盘股票的投资，在有效控制组合风险的基础上，力争持续实现超越业绩基准的超额收益。
投资策略	本基金为股票型证券投资基金，将采用“自上而下”的策略进行基金的大类资产配置。本基金主要通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、利率走势、证券市场估值水平等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，分析股票市场、债券市场、现金等大类资产的预期风险和收益，动态调整基金大类资产的投资比例，以控制系统性风险。
业绩比较基准	业绩基准收益率=80%×中证 700 指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。本基金主要投资于中小盘股票，在股票型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。
--------	---

2.2 基金产品说明（转型前）

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	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	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	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
基金保证人	重庆三峡融资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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 11 月 03 日（基金合同生效日）-2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	999,319.53

本期利润	-1,356,665.72
加权平均基金份额本期利润	-0.0062
本期基金份额净值增长率	-0.68%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0238
期末基金资产净值	203,337,463.79
期末基金份额净值	1.0238

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 01 月 01 日- 2018 年 11 月 02 日	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-35,641,001.60	86,408,070.58	76,035,075.22
本期利润	-807,539.49	46,477,311.72	67,647,358.79
加权平均基金份额本期利润	-0.0005	0.0209	0.0238
本期基金份额净值增长率	-0.10%	1.95%	2.39%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 11 月 2 日	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0279	0.0406	0.0299
期末基金资产净值	334,561,508.80	1,772,787,373.84	2,733,855,003.31
期末基金份额净值	1.0310	1.0410	1.0300

3.2 基金净值表现(转型后)

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
20181103-20181231	-0.68%	0.19%	-4.75%	1.05%	4.07%	-0.86%

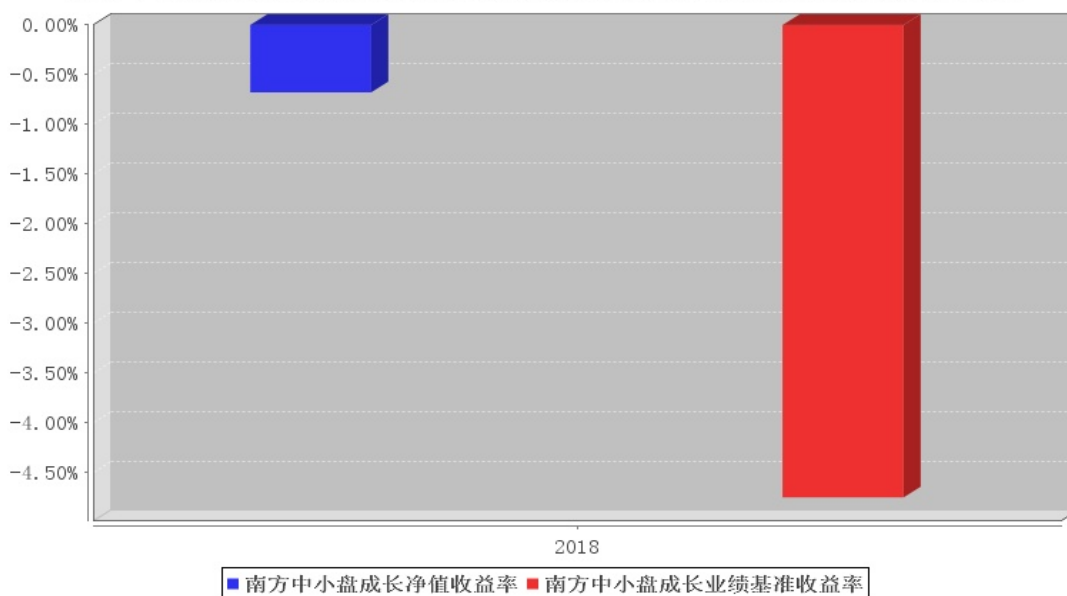
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方中小盘成长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



3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中小盘成长基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.2 基金净值表现（转型前）

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
20181001-20181102	-0.58%	0.11%	0.27%	0.01%	-0.85%	0.10%

20180701-20181102	0.00%	0.12%	1.02%	0.01%	-1.02%	0.11%
20180101-20181102	-0.10%	0.14%	2.54%	0.01%	-2.64%	0.13%
20160101-20181102	4.28%	0.11%	9.18%	0.01%	-4.90%	0.10%
20151028-20181102	4.90%	0.11%	9.80%	0.01%	-4.90%	0.10%

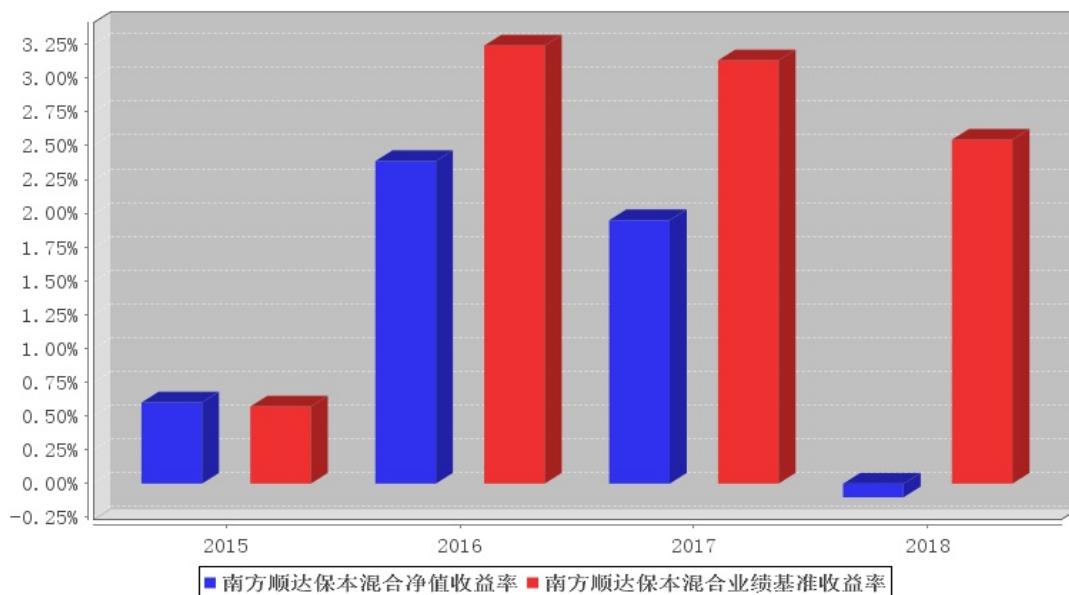
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方顺达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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方顺达保本混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

注：本基金自转型以来未进行利润分配。

3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

单位：元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2018 年	0.0900	14,906,343.55	-	14,906,343.55	-
2017 年	0.0900	19,084,180.96	-	19,084,180.96	-
2016 年	-	-	-	-	-
合计	0.1800	33,990,524.51	-	33,990,524.51	-

§ 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、南京等地设有分公司，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 8,300 亿元，旗下管理 178 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（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴剑毅	本基金基金经理	2015 年 10 月 28 日	-	10	清华大学金融学硕士，具有基金从业资格。2009 年 7 月加入南方基金，任南方基金研究部金融行业研究员；

					<p>2012 年 3 月至 2014 年 7 月，担任南方避险、南方保本基金经理助理；</p> <p>2015 年 11 月至 2017 年 12 月，任南方顺康保本基金经理；</p> <p>2014 年 7 月至 2018 年 1 月，任南方恒元基金经理；</p> <p>2015 年 9 月至 2018 年 11 月，任南方消费活力基金经理；</p> <p>2015 年 10 月至 2018 年 11 月，任南方顺达保本基金经理；</p> <p>2015 年 5 月至今，任南方利众基金经理；</p> <p>2015 年 7 月至今，任南方利达基金经理；</p> <p>2015 年 11 月至今，任南方利安基金经理；</p> <p>2016 年 12 月至今，任南方安颐混合基金经理；</p> <p>2017 年 8 月至今，任南方金融混合基金经理；</p> <p>2017 年 11 月至今，任南方安福混合基金经理；</p> <p>2017 年 12 月至今，任南方顺康混合基金经理；</p> <p>2018 年 2 月至今，任南方安养混合基金经理；</p> <p>2018 年 11 月至今，任南方中小盘成长股票基金经理。</p>
姚万宁	本基金基金经理助理	2015 年 11 月 23 日	-	6	<p>深圳大学金融学硕士，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入南方基金，担任投资部投资账户</p>

					助理；2015 年 11 月至今，任南方恒元、南方利众、南方利达、南方利安、南方顺达、南方顺康的基金经理助理；2016 年 12 月至今，任南方安颐养老基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴剑毅	本基金基金经理	2015 年 10 月 28 日	-	10	清华大学金融学硕士，具有基金从业资格。2009 年 7 月加入南方基金，任南方基金研究部金融行业研究员；2012 年 3 月至 2014 年 7 月，担任南方避险、南方保本基金基金经理助理；2015 年 11 月至 2017 年 12 月，任南方顺康保本基金基金经理；2014 年 7 月至 2018 年 1 月，任南方恒元基金经理；2015 年 9 月至 2018 年 11 月，任南方消费活力基金经理；2015 年 10 月至 2018 年 11 月，任南方顺达保本基金基金经理；2015 年 5 月至今，任南方利众基金经理；2015 年 7 月至今，任南方利达基金经理；2015 年 11 月至今，任南方利安基金经理；

					2016 年 12 月至今，任南方安颐混合基金经理；2017 年 8 月至今，任南方金融混合基金经理；2017 年 11 月至今，任南方安福混合基金经理；2017 年 12 月至今，任南方顺康混合基金经理；2018 年 2 月至今，任南方安养混合基金经理；2018 年 11 月至今，任南方中小盘成长股票基金经理。
姚万宁	本基金基金经理助理	2015 年 11 月 23 日	-	6	深圳大学金融学硕士，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入南方基金，担任投资部投资账户助理；2015 年 11 月至今，任南方恒元、南方利众、南方利达、南方利安、南方顺达、南方顺康的基金经理助理；2016 年 12 月至今，任南方安颐养老基金经理助理。

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、中国证监会和本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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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。

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，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、卖出溢价率、交易占优比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 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超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 7 次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及投资组合的投资策略需要所致。

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，国内经济下行压力加大，GDP 同比增长 6.6%，并呈现逐季回落趋势；在经济增速放缓、中美贸易摩擦加剧、债券违约事件频发以及股权质押风险暴露等多因素影响下，股票市场在 1 月短暂上扬后，步入单边下跌行情，报告期内上证综指下跌 24.59%，创业板指下跌 28.65%，沪深 300 指数下跌 25.31%。报告期内，市场的全面下跌为获取绝对收益增加了难度，本基金保本期于 2018 年 10 月 29 日到期，并于 11 月 3 日转型为南方中小盘成长股票型证券投资基金，有半年的建仓期。转型后产品的回撤容忍度有所提升，我们逐步增加了股票仓位，重点在

低估值或者估值相比国际水平有提升空间的板块中选择优质个股。固定收益投资方面，随着长端利率债收益率的下行，我们对当前长债持谨慎态度，组合整体固收资产配置以获取持有到期收益为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至转型后报告期末，本报告期（2018 年 11 月 3 日-2018 年 12 月 31 日）本基金份额净值为 1.0238 元，净值增长率为-0.68%，同期业绩比较基准增长率为-4.75%。

截至转型前报告期末，本报告期（2018 年 1 月 1 日-2018 年 11 月 2 日）本基金份额净值为 1.031，净值增长率为-0.10%。同期业绩比较基准增长率为 2.54%。

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 2019 年，经济仍然存在下行压力，贸易战的影响也将延续和反复，但在中美双方均面临经济放缓的情况下，双方仍有较强动力在谈判中达成协议。政策方面，国内政策定向宽松持续推进，而美联储加息和收表态度在松动，给国内信用扩张提供了政策空间；减税方案也有望逐步落地，预计较长时间内政策将维持友好态势。最后，从资金面上看，以外资为首的增量资金仍在源源不断进入市场，有利于优质个股持续企稳上涨。尽管经济及盈利增长压力增大，不确定性因素仍较多，但我们应该看到，当前 A 股整体市盈率估值已经回落至历史较低位置，众多指标均指向市场处于底部区域。虽然低估值并不必然意味着市场将上涨，但往往是获取高回报的基础。一直以来我们都坚持绝对收益选股需要寻找收敛机制，而最确定的收敛机制恰恰是时间，市盈率正是时间的代表，它代表了我们的投资回收年限，更是获取高股息的基础。低估值的公司，只要业绩保持稳定，最终每年业绩的增长将会体现到公司价值的提升，进而反应到股价的上涨。在系统性风险不大的前提下，我们认为市场的结构性行情仍将持续，配置上重点考虑两个方面的思路。一是当前股息收益率高的股票，只要盈利及分红比例能够保持稳定，那么就将吸引理财等固收类资金持续买入。另一类是估值相比国际水平低估或者稀缺的品种，它们将吸引大量的外资持续买入。随着沪港通、MSCI 资金的流入，A 股原本相对封闭的估值体系被打破，逐步融入国际市场中的一员，投资者结构逐步成熟，估值水平相对国际偏低的板块将继续获得估值提升的机会。

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企业会计准则、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

本基金由南方顺达保本混合型证券投资基金于 2018 年 11 月 3 日正式转型而来：（1）南方顺达保本基金合同关于收益分配的表述 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金合同生效满 1 年后，若基金在 6 月份和 12 月份最后一个交易日收盘后每份基金份额可分配利润金额高于 0.04 元(含)，则基金须在 15 个工作日之内进行收益分配，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 20%；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“南方中小盘成长股票型证券投资基金”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。（2）本基金合同关于收益分配的表述 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，基金合同生效满 1 年后，若基金在 6 月份和 12 月份最后一个交易日收盘后每份基金份额可分配利润金额高于 0.04 元(含)，则基金须在 15 个工作日之内进行收益分配，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 20%；本基金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，本报告期内 2018 年 1 月 16 日已分配数（每 10 份基金份额派发红利 0.09 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中小盘成长股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）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，本基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、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，本基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 14,906,343.55 元。

5.3 托管人对本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本基金 2018 年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 审计报告（转型后）

本基金 2018 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2019)第 23057 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 6 审计报告（转型前）

本基金 2018 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2019)第 23206 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表

会计主体：南方中小盘成长股票型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款		2,904,819.07
结算备付金		3,970,109.03
存出保证金		72,107.68
交易性金融资产		151,084,199.24
其中：股票投资		56,511,799.24
基金投资		-
债券投资		94,572,400.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		40,000,000.00
应收证券清算款		5,702,195.52
应收利息		760,171.65
应收股利		-
应收申购款		71,612.15
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		204,565,214.34
负债和所	附注号	本期末

所有者权益	2018 年 12 月 31 日	
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		286,789.19
应付管理人报酬		270,135.80
应付托管费		45,022.66
应付销售服务费		-
应付交易费用		200,691.77
应交税费		4,111.13
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		421,000.00
负债合计		1,227,750.55
所有者权 益:		
实收基金		198,608,307.35
未分配利润		4,729,156.44
所有者权 益合计		203,337,463.79
负债和所 有者权益 总计		204,565,214.34

注:1. 报告截止日 2018 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.0238 元, 基金份额总额 198,608,307.35 份。2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 11 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：南方中小盘成长股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 11 月 3 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2018 年 11 月 3 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		-463,493.49
1. 利息收入		960,122.05
其中：存款利息收入		87,941.78
债券利息收入		515,822.11
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		356,358.16
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		930,394.58
其中：股票投资收益		930,394.58
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-2,355,985.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填		-

列)		
5. 其他收入(损失以“-”号填列)		1,975.13
减: 二、费用		893,172.23
1. 管理人报酬		541,561.20
2. 托管费		90,260.20
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		165,339.67
5. 利息支出		1,214.74
其中: 卖出回购金融资产支出		1,214.74
6. 税金及附加		785.05
7. 其他费用		94,011.37
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-1,356,665.72
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-1,356,665.72

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 南方中小盘成长股票型证券投资基金

本报告期: 2018 年 11 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 11 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 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)	324,584,179.37	9,977,329.43	334,561,508.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期	-	-1,356,665.72	-1,356,665.72

利润)			
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)	-125,975,872.02	-3,891,507.27	-129,867,379.29
其中：1. 基金申购款	2,939,175.63	88,982.53	3,028,158.16
2. 基金赎回款	-128,915,047.65	-3,980,489.80	-132,895,537.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	198,608,307.35	4,729,156.44	203,337,463.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方中小盘成长股票型证券投资基金是根据原南方顺达保本混合型证券投资基金(以下简称“南方顺达保本混合基金”)《南方顺达保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,由南方顺达保本混合基金转型而来。原南方顺达保本混合基金为契约型开放式基金,存续期限不定,南方顺达保本混合基金第一个保本期于 2018 年 10 月 29 日到期,但基金管理人无法为南方顺达保本混合基金转入下一保本期确定保本担保人,南方顺达保本混合基金不能满足继续作为法律法规规定的避险策略型基金运作的条件,基金管理人经与托管人协商一致,根据《南方顺达保本混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为非保本的股票型基金,即自 2018 年 11 月 3 日起,南方顺达保本混合基金更名为南方中小盘成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),《南方中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。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《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金可以投资于 A 股股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、中期票据、银行存款等货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券及中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于具有高成长性、基本面良好的中小盘股票的资产合计不低于非现金资产的 80%；债券、中期票据、权证、货币市场工具、资产支持证券及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 5%-20%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，基金持有权证的市场价值不得超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为： $80\% \times \text{中证 700 指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2019 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 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》、《南方中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 11 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 11 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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：

(1) 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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 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。

7.4.6.1 资产负债表日后事项

无。

7.4.7 关联方关系

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	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
	2018 年 11 月 3 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	63,026,141.32	49.65

7.4.8.1.2 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11月3日（基金合同生效日）至2018年12月31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	57,435.90	49.67	88,609.93	44.33

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年11月3日（基金合同生效日）至2018年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	541,561.20
其中：支付销售机构的客户维护费	216,456.35

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 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年11月3日（基金合同生效日）至2018年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	90,260.20

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 × 0.25%/ 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

注:无。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年11月3日(基金合同生效日)至2018年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	2,904,819.07	62,275.59

注:本基金由基金托管人中国工商银行保管的银行存款,按银行约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量(股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000540	中金金融	2017-08-21	重大资产重	2.72	2019-01-02	4.38	2,154,511	9,549,031.15	5,860,269.92	-

			组							
002183	怡亚通	2018-12-25	拟披露重大事项	5.01	2019-01-02	4.96	128,000	685,266.00	641,280.00	-

注：本基金截至 2018 年 12 月 31 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 50,010,249.32 元，属于第二层次的余额为 95,213,680.00 元，属于第三层次的余额为 5,860,269.92 元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下:

	交易性金融资产		合计
	债券投资	权益工具投资	
2018 年 11 月 3 日 (基金合同生效日)	-	5,860,269.92	5,860,269.92
购买	-	-	-
出售	-	-	-
转入第三层级	-	-	-
转出第三层级	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
计入损益的利得或损失	-	-	-
2018 年 12 月 31 日	-	5,860,269.92	5,860,269.92
2018 年 12 月 31 日仍 持有的资产计入 2018 年度损益的未实 现利得或损失的变动 ——公允价值变动损益	-	-	-

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下:

	2018 年 12 月 31 日 公允价值	估值技 术	不可观察输入值		与公允价 值之间的 关系
			名称	范围/加权平 均值	
交易性金 融资产— —股票投 资	5,860,269.92	情景分析 法、市场 法	情景分析法: 收购成功概率; 市场法: 市净率倍数	情景分析法: 0.5 市场法: 1.41	正相关

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表

会计主体：南方顺达保本混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 11 月 2 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 11 月 2 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		483,703,405.46	5,166,851.84
结算备付金		14,350,000.00	1,946,668.58
存出保证金		61,104.24	40,035.16
交易性金融资产		7,125,255.92	1,645,823,284.02
其中：股票投资		7,125,255.92	234,446,700.32
基金投资		-	-
债券投资		-	1,411,376,583.70
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	115,032,270.05
应收证券清算款		-	3,720,981.77
应收利息		165,820.92	31,409,156.60
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		505,405,586.54	1,803,139,248.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 11 月 2 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	27,000,000.00
应付证券清算款		-	483,883.03
应付赎回款		168,480,343.48	-
应付管理人报酬		1,562,320.41	2,011,309.24
应付托管费		240,356.98	309,432.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		166,642.62	168,228.76
应交税费		66,614.81	-
应付利息		-	-11,979.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		327,799.44	391,000.00
负债合计		170,844,077.74	30,351,874.18
所有者权益：			
实收基金		324,584,179.37	1,703,577,978.58
未分配利润		9,977,329.43	69,209,395.26
所有者权益合计		334,561,508.80	1,772,787,373.84
负债和所有者权益总计		505,405,586.54	1,803,139,248.02

注：1. 报告截止日 2018 年 11 月 2 日(基金合同失效前日)，基金份额净值 1.031 元，基金份额总额 324,584,179.37 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 2 日(基金合同失效前日)。

7.2 利润表

会计主体：南方顺达保本混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 2 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 2 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		20,865,387.26	90,062,622.07
1. 利息收入		46,688,052.31	80,335,515.68
其中：存款利息收入		277,486.97	31,563,987.21
债券利息收入		43,410,123.14	48,194,399.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,000,442.20	577,128.70
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		-62,202,252.75	43,455,843.84

” 填列)			
其中：股票投资收益		-54,634,840.89	40,317,959.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-10,453,467.13	63,265.83
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		2,886,055.27	3,074,618.42
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)		34,833,462.11	-39,930,758.86
4. 汇兑收益(损失以“-”号填 列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填 列)		1,546,125.59	6,202,021.41
减：二、费用		21,672,926.75	43,585,310.35
1. 管理人报酬		16,858,855.57	30,137,499.44
2. 托管费		2,593,670.13	4,636,538.39
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		1,493,057.41	597,388.00
5. 利息支出		309,323.79	7,779,063.85
其中：卖出回购金融资产支 出		309,323.79	7,779,063.85
6. 税金及附加		49,383.40	-
7. 其他费用		368,636.45	434,820.67
三、利润总额(亏损总额以 “-”号填列)		-807,539.49	46,477,311.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“- ”号填列)		-807,539.49	46,477,311.72

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方顺达保本混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 2 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 2 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）	1,703,577,978.58	69,209,395.26	1,772,787,373.84
二、本期经营活	-	-807,539.49	-807,539.49

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
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）	-1,378,993,799.21	-43,518,182.79	-1,422,511,982.00
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-1,378,993,799.21	-43,518,182.79	-1,422,511,982.00
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）	-	-14,906,343.55	-14,906,343.55
五、期末所有者权益（基金净值）	324,584,179.37	9,977,329.43	334,561,508.80
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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）	2,654,427,797.92	79,427,205.39	2,733,855,003.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	46,477,311.72	46,477,311.72
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）	-950,849,819.34	-37,610,940.89	-988,460,760.23
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-950,849,819.34	-37,610,940.89	-988,460,760.23
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	-	-19,084,180.96	-19,084,180.96

减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,703,577,978.58	69,209,395.26	1,772,787,373.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方顺达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[2013]1090号《关于准予南方顺达保本混合型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2015]2519号《关于南方顺达保本混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《南方顺达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2,978,335,733.81元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第1202号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方顺达保本混合型证券投资基金基金合同》于2015年10月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,979,388,098.06份基金份额,其中认购资金利息折合1,052,364.25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,担保人为重庆市三峡担保集团有限公司。

根据本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于2018年10月11日发布的《南方顺达保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为南方中小盘成长股票型证券投资基金相关业务规则的公告》以及《关于修订〈南方顺达保本混合型证券投资基金基金合同〉的公告》,本基金第一个保本期于2018年10月29日到期,但基金管理人无法为本基金转入下一保本期确定保本担保人,本基金将不能满足继续作为法律法规规定的避险策略型基金运作的条件。经与基金托管人协商一致,将按照本基金基金合同的约定转型为非保本的股票型基金,名称相应变更为“南方中小盘成长股票型证券投资基金”。自2018年11月3日起,本基金正式转型为南方中小盘成长股票型证券投资基金,转型后的《南方中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》自该日起生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方顺达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，但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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的保证，并在此基础上力争基金资产的稳定增值。在保本到期日，如按基金份额持有人认购并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认购并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保本金额，则基金管理人补足该差额，并由保证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%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2019 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 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》、《南方顺达保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

经中国证监会批准，基金管理人南方基金管理股份有限公司将本基金于基金合同失效日转型为南方中小盘成长股票型证券投资基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 2 日(基金合同失效前日)止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 11 月 2 日(基金合同失效前日)的财务状

况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 2 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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:

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 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。

7.4.6.1 资产负债表日后事项

《南方顺达保本混合型证券投资基金基金合同》自 2018 年 11 月 3 日起失效，《南方中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》于同日起生效，同时本基金更名为南方中小盘成长股票型证券投资基金。

7.4.7 关联方关系

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	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年11月2日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	303,859,593.54	32.68	100,473,270.18	26.89

7.4.8.1.2 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11月2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	276,884.85	32.69	70,191.04	42.24
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	91,561.64	26.85	73,753.82	44.40

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 11月2日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,858,855.57	30,137,499.44
其中：支付销售机构的客户维护费	5,377,775.24	9,540,234.70

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 × 1.30%/ 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年11月2日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,593,670.13	4,636,538.39

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 0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.20%/ 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

注:无。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年11月2日		2017年1月1日至2017年12月31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	483,703,405.46	247,435.61	5,166,851.84	143,740.78

注:本基金由基金托管人中国工商银行保管的银行存款,按银行约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2018 年 11 月 02 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量(股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000538	云南白药	2018-09-19	重大资产重组	68.01	2018-11-23	68.82	18,600	1,483,792.00	1,264,986.00	-
000540	中天金融	2017-08-21	重大资产重组	2.72	2019-01-02	4.38	2,154,511	9,549,031.15	5,860,269.92	-

注:本基金截至 2018 年 11 月 2 日(基金合同失效前日)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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注:无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 11 月 2 日(基金合同失效前日)，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 1,264,986.00 元，属于第三层次的余额为 5,860,269.92 元，无属于第一层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 204,441,058.36 元，第二层次 1,441,382,225.66 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下:

	交易性金融资产		合计
	债券投资	权益工具投资	
2018 年 1 月 1 日	-	-	-
购买	-	-	-
出售	-	-	-
转入第三层级	-	5,860,269.92	5,860,269.92
转出第三层级	-	-	-
当期利得或损失总额			
计入损益的利得或损失	-	-	-
2018 年 11 月 2 日 (基金合同失效前日)	-	5,860,269.92	5,860,269.92
2018 年 11 月 2 日(基金合同失效前日)仍持有的资产计入 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 2 日(基金合同失效前日)止期间损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-4,696,836.43	-4,696,836.43

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下:

	2018 年 11 月 2 日 公允价值	估值技术	不可观察输入值		与公允价值之间的关系
			名称	范围/加权平均值	
交易性金融资产——股票投资	5,860,269.92	情景分析法、市场法	情景分析法: 收购成功概率; 市场法: 市净率倍数	情景分析法: 0.5 市场法: 1.41	正相关

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具于 2018 年 11 月 2 日(基金合同失效前日), 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告 (转型后)

8.1 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	56,511,799.24	27.63
	其中: 股票	56,511,799.24	27.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	94,572,400.00	46.23
	其中: 债券	94,572,400.00	46.23
	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	40,000,000.00	19.55
	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	6,874,928.10	3.36
8	其他各项资产	6,606,087.00	3.23
9	合计	204,565,214.34	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位: 人民币元

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	885,500.00	0.44
B	采矿业	1,492,883.00	0.73
C	制造业	28,463,010.00	14.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	1,406,878.00	0.69
F	批发和零售业	2,488,022.00	1.22
G	交通运输、仓储和邮政业	1,155,077.00	0.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,141,759.00	0.56
J	金融业	9,631,617.00	4.74
K	房地产业	5,860,269.92	2.88
L	租赁和商务服务业	2,712,877.32	1.33
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,273,906.00	0.63
S	综合	-	-
	合计	56,511,799.24	27.79

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601009	南京银行	963,900	6,226,794.00	3.06
2	000540	中天金融	2,154,511	5,860,269.92	2.88
3	600056	中国医药	332,400	4,178,268.00	2.05
4	600741	华域汽车	156,600	2,881,440.00	1.42
5	002027	分众传媒	395,343	2,071,597.32	1.02
6	603368	柳药股份	56,200	1,472,440.00	0.72
7	603579	荣泰健康	42,400	1,202,464.00	0.59
8	002008	大族激光	38,800	1,177,968.00	0.58
9	002661	克明面业	85,200	1,051,368.00	0.52
10	601166	兴业银行	68,300	1,020,402.00	0.50

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601009	南京银行	6,356,553.00	3.13
2	002027	分众传媒	4,432,961.00	2.18
3	600056	中国医药	4,353,015.20	2.14
4	600741	华域汽车	2,799,813.31	1.38
5	603579	荣泰健康	1,906,891.54	0.94
6	603368	柳药股份	1,468,447.00	0.72
7	300144	宋城演艺	1,386,718.00	0.68
8	000963	华东医药	1,266,721.00	0.62
9	002008	大族激光	1,197,428.95	0.59
10	601636	旗滨集团	1,143,002.00	0.56
11	600518	康美药业	1,134,310.00	0.56
12	300618	寒锐钴业	1,122,062.00	0.55
13	601288	农业银行	1,102,694.00	0.54
14	000066	中国长城	1,085,338.00	0.53
15	002661	克明面业	1,063,987.00	0.52
16	600036	招商银行	1,034,575.00	0.51
17	601166	兴业银行	1,021,768.00	0.50
18	002371	北方华创	999,703.60	0.49
19	601600	中国铝业	998,940.00	0.49
20	300364	中文在线	995,456.00	0.49

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002027	分众传媒	2,263,133.42	1.11
2	000538	云南白药	1,400,252.00	0.69
3	300618	寒锐钴业	1,140,346.00	0.56
4	601288	农业银行	1,103,760.00	0.54
5	002925	盈趣科技	1,090,656.00	0.54
6	002739	万达电影	952,797.00	0.47
7	603589	口子窖	941,610.00	0.46
8	600779	水井坊	843,896.00	0.42
9	603337	杰克股份	812,358.00	0.40
10	300109	新开源	732,280.38	0.36
11	600398	海澜之家	726,855.59	0.36
12	300124	汇川技术	695,770.74	0.34
13	002292	奥飞娱乐	683,939.10	0.34
14	603579	荣泰健康	683,333.00	0.34
15	002677	浙江美大	680,332.00	0.33
16	300144	宋城演艺	671,046.00	0.33
17	300369	绿盟科技	637,505.00	0.31

18	300747	锐科激光	637,475.00	0.31
19	603528	多伦科技	632,371.00	0.31
20	601777	力帆股份	630,327.00	0.31

8.4.3 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	88,855,815.24
卖出股票收入（成交）总额	38,073,717.37

8.5 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	10,042,000.00	4.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	12,959,400.00	6.37
	其中：政策性金融债	3,993,600.00	1.96
4	企业债券	32,925,000.00	16.19
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	38,646,000.00	19.01
9	其他	-	-
10	合计	94,572,400.00	46.51

8.6 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	111813152	18 浙商银行 CD152	200,000	19,328,000.00	9.51
2	111888340	18 杭州银行 CD080	200,000	19,318,000.00	9.50
3	120016	12 付息国债 16	100,000	10,042,000.00	4.94
4	143761	18 电投 04	90,000	9,118,800.00	4.48
5	136830	16 中信 G1	90,000	8,965,800.00	4.41

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：无。

8.8 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:无。

8.9 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:无。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:无。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

报告期内基金投资的前十名证券除 18 浙商银行 CD152（证券代码 111813152）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2018 年 11 月 9 日，中国银保监会对浙商银行进行行政处罚，违规原因为：（一）投资同业理财产品未尽职审查；（二）为客户缴交土地出让金提供理财资金融资；（三）投资非保本理财产品违规接受回购承诺；（四）理财产品销售文本使用误导性语言；（五）个人理财资金违规投资；（六）理财产品相互交易，业务风险隔离不到位；（七）为非保本理财产品提供保本承诺。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资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。

8.12.2 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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

8.12.3 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	72,107.68
2	应收证券清算款	5,702,195.52
3	应收股利	-
4	应收利息	760,171.65
5	应收申购款	71,612.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	6,606,087.00

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000540	中天金融	5,860,269.92	2.88	重大资产重组

§ 8 投资组合报告 (转型前)

8.1 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	7,125,255.92	1.41
	其中:股票	7,125,255.92	1.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	498,053,405.46	98.55
8	其他各项资产	226,925.16	0.04
9	合计	505,405,586.54	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

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	1,264,986.00	0.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,860,269.92	1.75
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,125,255.92	2.13

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000540	中天金融	2,154,511	5,860,269.92	1.75
2	000538	云南白药	18,600	1,264,986.00	0.38

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	15,421,479.00	0.87
2	601166	兴业银行	12,976,384.00	0.73
3	601668	中国建筑	12,758,900.00	0.72
4	000568	泸州老窖	10,955,280.02	0.62
5	601328	交通银行	8,425,623.00	0.48
6	000651	格力电器	7,682,147.96	0.43

7	600808	马钢股份	7,544,573.81	0.43
8	000717	韶钢松山	7,542,871.00	0.43
9	600926	杭州银行	7,516,605.40	0.42
10	000333	美的集团	6,902,984.49	0.39
11	601009	南京银行	6,858,465.48	0.39
12	600030	中信证券	6,669,803.00	0.38
13	002027	分众传媒	6,265,131.40	0.35
14	000786	北新建材	6,059,482.66	0.34
15	600048	保利地产	5,831,259.00	0.33
16	600597	光明乳业	5,672,687.00	0.32
17	600028	中国石化	5,108,881.00	0.29
18	600019	宝钢股份	5,085,986.00	0.29
19	600000	浦发银行	5,078,369.00	0.29
20	600581	八一钢铁	5,047,998.00	0.28

8.4.2 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	601288	农业银行	13,712,712.00	0.77
2	600223	鲁商置业	12,321,250.71	0.70
3	601668	中国建筑	11,748,854.93	0.66
4	601166	兴业银行	11,697,314.00	0.66
5	600015	华夏银行	11,428,186.80	0.64
6	002029	七匹狼	10,630,632.80	0.60
7	002344	海宁皮城	9,836,245.80	0.55
8	000568	泸州老窖	9,834,500.00	0.55
9	601788	光大证券	9,142,399.13	0.52
10	600600	青岛啤酒	8,857,858.56	0.50
11	601328	交通银行	7,973,364.00	0.45
12	000651	格力电器	7,686,075.35	0.43
13	600837	海通证券	7,578,072.81	0.43
14	600016	民生银行	7,506,648.00	0.42
15	600109	国金证券	6,815,562.00	0.38
16	600926	杭州银行	6,530,580.65	0.37
17	002353	杰瑞股份	6,494,723.50	0.37
18	600153	建发股份	6,472,406.34	0.37
19	000717	韶钢松山	6,116,714.98	0.35
20	601009	南京银行	6,070,093.60	0.34

8.4.3 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	372,235,491.54
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	560,104,280.81
--------------	----------------

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

8.6 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

注：无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：无。

8.8 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：无。

8.9 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：无。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：无。

8.11.1 本期国债期货投资评价

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	61,104.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	165,820.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	226,925.16

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000540	中天金融	5,860,269.92	1.75	重大资产重组
2	000538	云南白药	1,264,986.00	0.38	重大资产重组

§9 基金份额持有人信息 (转型后)

9.1 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 (%)
3,537	56,151.63	100,483.95	0.05	198,507,823.40	99.95

9.2 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	300,440.96	0.1513

9.3 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的情况

注:无。

§9 基金份额持有人信息 (转型前)

9.1 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 (%)
3,877	83,720.45	15,028,973.01	4.63	309,555,206.36	95.37

9.2 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	300,440.96	0.1513

9.3 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的情况

注:无。

§ 10 开放式基金份额变动 (转型后)

单位:份

基金合同生效日 (2018 年 11 月 3 日) 基金份额总额	324,584,179.37
本报告期期初基金份额总额	324,584,179.37
本报告期基金总申购份额	2,939,175.63
减:本报告期基金总赎回份额	128,915,047.65
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	198,608,307.35

§ 10 开放式基金份额变动 (转型前)

单位:份

基金合同生效日 (2015 年 10 月 28 日) 基金份额总额	2,979,388,098.06
本报告期期初基金份额总额	1,703,577,978.58
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	1,378,993,799.21
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	324,584,179.37

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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未发生重大人事变动。

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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

南方中小盘成长股票型证券投资基金是根据原南方顺达保本混合型证券投资基金《南方顺达保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，由南方顺达保本混合型证券投资基金转型而来。转型前基金投资策略见 2.2（转型前）；转型后基金投资策略见 2.2（转型后）。

11.5 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。本年度支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用 121,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 5 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

11.7.1 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	
海通证券	1	63,903,391.29	50.35%	58,190.89	50.33%	-
华泰证券	1	63,026,141.32	49.65%	57,435.90	49.67%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2 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	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	41,875,440.00	100.00%	1,063,000,000.00	100.00%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

11.7.1 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	
瑞银证券	1	378,997,984.19	40.76%	345,377.35	40.77%	-
华泰证券	1	303,859,593.54	32.68%	276,884.85	32.69%	-
安信证券	1	94,103,243.39	10.12%	85,738.95	10.12%	-
海通证券	1	67,254,817.34	7.23%	61,110.37	7.21%	-
方正证券	1	58,415,679.30	6.28%	53,232.71	6.28%	-
中金公司	1	13,797,858.28	1.48%	12,573.81	1.48%	-
中信建投	1	13,376,972.09	1.44%	12,190.32	1.44%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2 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	3,503,530.00	1.97%	1,506,000,000.00	27.10%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	410,000.00	0.23%	2,214,000,000.00	39.84%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	172,913,500.00	97.25%	265,000,000.00	4.77%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	590,250.56	0.33%	-	-	-	-
瑞银证券	195,530.90	0.22%	1,572,000,000.00	28.29%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息（转型后）

12.1 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。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息（转型前）

12.1 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。