

# 南方新优享灵活配置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。

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。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	南方新优享灵活配置混合	
基金主代码	000527	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 2 月 26 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	1,740,806,666.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	南方新优享 A	南方新优享 C
下属分级基金的交 易代码	000527	006590
报告期末下属分级 基金的份额总额	1,740,797,794.42 份	8,872.30 份

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“南方新优享”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 姓名	常克川	郭明

负责人	联系电话	0755-82763888	010-66105798
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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

## §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

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12月31日)		报告期(2017年01月01日-2017年12月31日)		报告期(2016年01月01日-2016年12月31日)	
	南方新优享 A	南方新优享 C	南方新优享 A	南方新优享 C	南方新优享 A	南方新优享 C
本期已实现收益	-641,962,403.70	-97.79	111,780,009.18	-	20,859,880.54	-
本期利润	-745,278,381.22	148.13	251,154,877.58	-	4,824,660.32	-
加权平均基金份额本期利润	-0.4887	0.0295	0.5984	-	0.0402	-
本期基金份额净值增长率	-17.38%	1.16%	31.26%	-	2.33%	-
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
期末可供分配基金份额利润	1.0923	1.0934	1.5146	-	0.9290	-
期末基金资产净值	3,642,316,315.45	18,573.05	1,757,101,540.78	-	255,576,626.84	-
期末基金份额净值	2.092	2.093	2.532	-	1.929	-

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。

4. 本基金从 2018 年 12 月 18 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2018 年 12 月 19 日起存续。

### 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

南方新优享 A

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
过去三个月	-9.94%	1.37%	-6.83%	0.98%	-3.11%	0.39%
过去六个月	-14.72%	1.30%	-7.52%	0.90%	-7.20%	0.40%
过去一年	-17.38%	1.25%	-13.74%	0.80%	-3.64%	0.45%
过去三年	10.98%	1.18%	-7.54%	0.71%	18.52%	0.47%
自基金合同 生效起至今	109.20%	1.50%	36.46%	0.93%	72.74%	0.57%

南方新优享 C

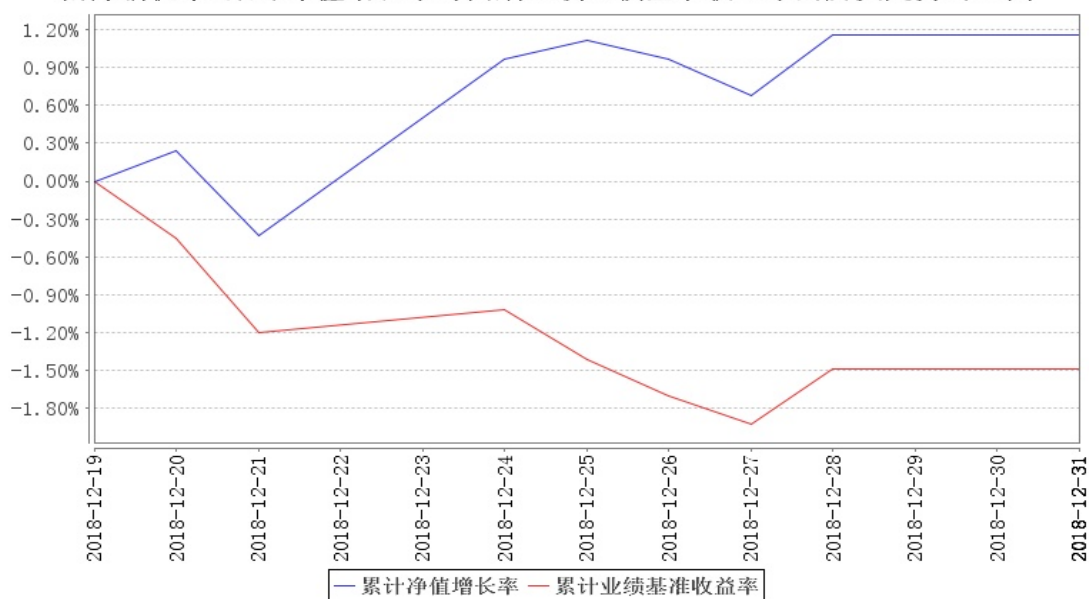
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
自基金合同 生效起至今	1.16%	0.62%	-1.48%	0.38%	2.64%	0.24%

### 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

南方新优享A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

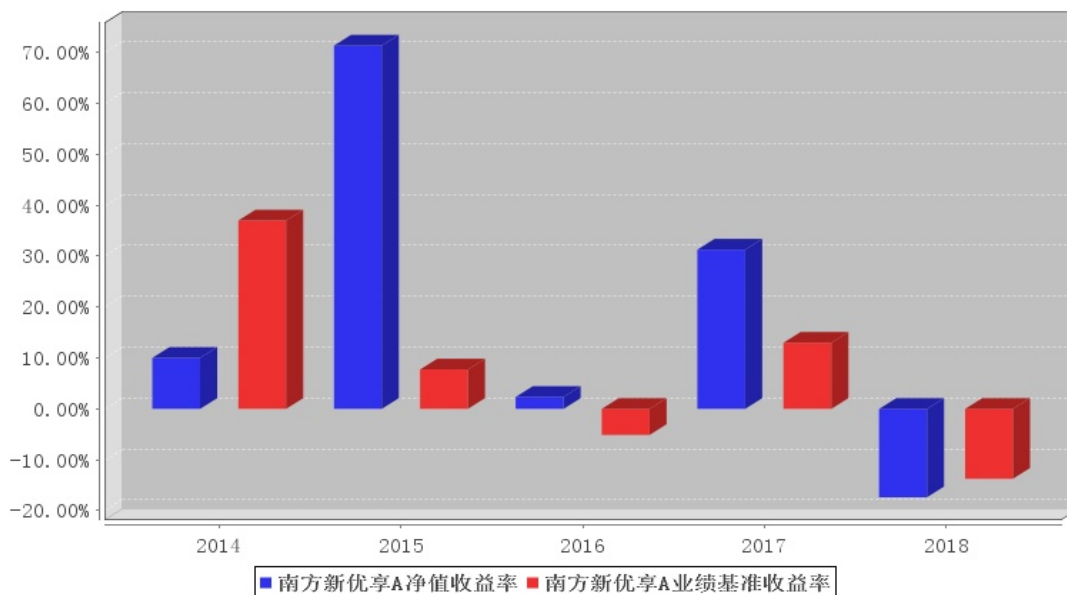


南方新优享C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

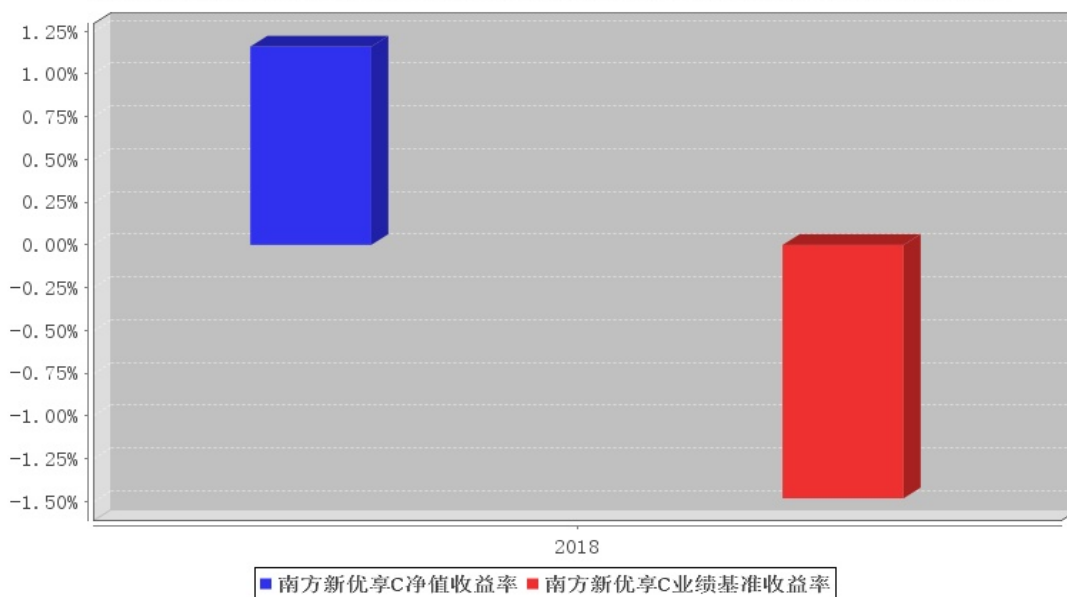


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方新优享A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



南方新优享C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



注:1、本基金于 2014 年 2 月 26 日成立, 成立当年净值增长率按当年实际存续期计算。

2、本基金从 2018 年 12 月 18 日起新增 C 类份额, C 类份额自 2018 年 12 月 19 日起存续, 故存续起始当年净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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

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		
章晖	本基金基金经理	2015 年 5 月 28 日	-	9	北京大学西方经济学硕士，具有基金从业资格、金融分析师（CFA）资格，2009 年 7 月加入南方基金，担任研究部研究员、高级研究员；2014 年 2 月至 2015 年 5 月，任南方新优享基金经理助理；2015 年 5 月至今，任南方新优享基金经理；2015 年 6 月至今，任南方创新经济基金经理；2018 年 4 月至今，任南方成安优选混合基金经理。
史博	本基金基金经理	2014 年 2 月 26 日	2018 年 11 月 16 日	20	特许金融分析师（CFA），硕士学历，具有基金从业资格。曾任职于博时基金管理有限公司、中国人寿资产管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司。2004 年 7 月至 2005 年 2 月，任泰达周期基金经理；2007 年 7 月至 2009 年 5 月任泰达首选基金经理；2008 年 8 月至 2009 年 9 月任泰达市值基金经理；2009 年 4 月至 2009 年 9 月任泰达品质基金经理。2009 年 10 月加入南方基金，现任南方基金副总裁兼首席投资官（权益）



					、资产配置委员会主席、境内权益投资决策委员会主席、国际投资决策委员会主席、公募业务协同发展委员会副主席。2014 年 2 月至 2018 年 11 月，任南方新优享基金经理；2015 年 9 月至 2018 年 11 月，任南方消费活力基金经理；2011 年 2 月至今，任南方绩优基金经理；2017 年 3 月至今，任南方智慧混合基金经理；2018 年 5 月至今，任南方瑞祥一年混合基金经理；2018 年 9 月至今，任南方瑞合基金经理。
--	--	--	--	--	---

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，“离职日期”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《南方新优享灵活配置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，两两组合同单日、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。

#### 4.3.3 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年是A股历史上跌幅第二的年份，所有指数都下跌，电子和有色行业的跌幅甚至超过40%。新优享基金全年跑输了业绩基准，主要是对于市场风险偏好下降的幅度有所低估。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金A份额净值为2.092元，报告期内，份额净值增长率为-17.38%，同期业绩基准增长率为-13.74%；本报告期内，基金持有人未实际持有本基金C类份额。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在目前时点，风险偏好已经处于较低位置，资金利率相比去年有显著下降，上市公司业绩虽无明显向好迹象但市场当前的估值水平对此已有反应。我们判断指数下行空间应该有限，但个股间的分化会非常大。我们会把今年的主要工作放在选股上，力争找到能够相对独立经济周期、可持续成长的股票，给投资者带来回报。

#### 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；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为同一类别的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；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方新优享灵活配置混合型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，南方新优享灵活配置混合型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新优享灵活配置混合型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，南方新优享灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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南方新优享灵活配置混合型证券投资基金 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

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 23146 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

### 7.1 资产负债表

会计主体: 南方新优享灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日: 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		
银行存款	29,961,809.92	89,139,296.48
结算备付金	97,152,000.79	43,093,366.44
存出保证金	2,077,466.59	820,896.59
交易性金融资产	2,663,420,032.52	1,268,804,703.07
其中: 股票投资	2,367,808,421.68	1,175,293,959.87
基金投资	-	-
债券投资	295,611,610.84	93,510,743.20
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	870,000,000.00	300,000,000.00
应收证券清算款	432,730.46	19,659,443.93
应收利息	4,939,257.27	2,085,162.82
应收股利	-	-
应收申购款	1,769,442.86	52,858,422.09
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,669,752,740.41	1,776,461,291.42
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	10,872,907.06	8,379,053.63

应付赎回款	3,341,800.94	4,583,615.29
应付管理人报酬	4,705,735.71	2,076,700.41
应付托管费	784,289.30	346,116.75
应付销售服务费	3.36	-
应付交易费用	7,304,009.68	3,598,428.65
应交税费	124.99	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	408,980.87	375,835.91
负债合计	27,417,851.91	19,359,750.64
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,740,806,666.72	693,937,333.29
未分配利润	1,901,528,221.78	1,063,164,207.49
所有者权益合计	3,642,334,888.50	1,757,101,540.78
负债和所有者权益总计	3,669,752,740.41	1,776,461,291.42

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,740,806,666.72 份，其中南方新优享灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额总额为 1,740,797,794.42 份，基金份额净值 2.092 元；南方新优享灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额总额为 8,872.30 份，基金份额净值 2.093 元。

## 7.2 利润表

会计主体：南方新优享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

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 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-629,895,270.25	285,029,789.83
1. 利息收入	33,147,335.80	10,703,949.24
其中：存款利息收入	2,566,966.48	855,568.58
债券利息收入	5,708,164.84	1,025,620.50
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	24,872,204.48	8,822,760.16
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-567,504,500.11	132,421,872.74
其中：股票投资收益	-594,543,460.56	126,454,467.61
基金投资收益	-	-
债券投资收益	811,366.34	-68,763.19
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	26,227,594.11	6,036,168.32
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-103,315,731.60	139,374,868.40
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7,777,625.66	2,529,099.45
减：二、费用	115,382,962.84	33,874,912.25
1. 管理人报酬	53,850,362.72	14,122,494.93
2. 托管费	8,975,060.57	2,353,749.14
3. 销售服务费	3.36	-
4. 交易费用	52,117,206.63	16,990,351.35
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	13.40	-
7. 其他费用	440,316.16	408,316.83
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-745,278,233.09	251,154,877.58
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-745,278,233.09	251,154,877.58

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方新优享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 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）	693,937,333.29	1,063,164,207.49	1,757,101,540.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-745,278,233.09	-745,278,233.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,046,869,333.43	1,583,642,247.38	2,630,511,580.81

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	1,887,578,935.51	2,791,185,525.09	4,678,764,460.60
2. 基金赎回款	-840,709,602.08	-1,207,543,277.71	-2,048,252,879.79
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)	1,740,806,666.72	1,901,528,221.78	3,642,334,888.50
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)	132,491,471.51	123,085,155.33	255,576,626.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	251,154,877.58	251,154,877.58
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)	561,445,861.78	688,924,174.58	1,250,370,036.36
其中：1. 基金申购款	866,814,984.10	1,095,780,437.44	1,962,595,421.54
2. 基金赎回款	-305,369,122.32	-406,856,262.86	-712,225,385.18
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)	693,937,333.29	1,063,164,207.49	1,757,101,540.78

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 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

#### 7.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.1.2 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。

#### 7.4.1.3 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。

### 7.4.2 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。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。

(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。

### 7.4.3 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(“兴业证券”)	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。

### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.4.1.1 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12月 31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 (%)
兴业证券	4,959,343,685.16	14.02	2,449,358,016.98	21.19
华泰证券	1,970,264,057.00	5.57	-	-

#### 7.4.4.1.2 权证交易

无。

#### 7.4.4.1.3 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	1,795,504.83	5.57	224,814.76	3.08
兴业证券	4,519,460.02	14.02	722,205.38	9.89
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	-	-	-	-
兴业证券	2,232,104.39	21.15	951,583.90	26.45

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。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31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	53,850,362.72	14,122,494.93
其中：支付销售机构的客户维护费	16,042,888.06	1,903,494.32

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 X 1.50% / 当年天数。

#### 7.4.4.2.2 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 12 月 31 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	8,975,060.57	2,353,749.14

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。

#### 7.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方新优享 A	南方新优享 C	合计
南方基金	-	0.25	0.25
合计	-	0.25	0.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方新优享 A	南方新优享 C	合计
南方基金	-	-	-
合计	-	-	-

注：自 2018 年 12 月 18 日起，支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 X 0.80% / 当年天数。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

## 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日	
	南方新优享 A	南方新优享 C
基金合同生效日（2014 年 2 月 26 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	6,635,036.49	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	6,635,036.49	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.38%	-
项目	上年度可比期间 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日
	南方新优享 A	南方新优享 C
基金合同生效日（2014 年 2 月 26 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	6,635,036.49	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	6,635,036.49	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.96%	-

## 7.4.4.4.2 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

无。

## 7.4.4.5 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12月 31日		上年度可比期间 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	29,961,809.92	1,104,245.40	89,139,296.48	454,344.76

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。

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.5 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.5.1 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

7.4.12.1.1 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
601138	工业富联	2018-05-28	2019-06-10	新 股 配 售	13.77	10.97	1,699,079	23,396,317.83	18,638,896.63	-
601860	紫金银行	2018-12-20	2019-01-03	新 股 未 上 市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

##### 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

### 7.4.6 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 2,354,114,990.09 元，属于第二层次的余额为 309,305,042.43 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 1,122,473,863.79 元，第二层次 146,330,839.28 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

无。

##### (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(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

### 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	2,367,808,421.68	64.52
	其中：股票	2,367,808,421.68	64.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	295,611,610.84	8.06
	其中：债券	295,611,610.84	8.06
	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	870,000,000.00	23.71
	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	127,113,810.71	3.46
8	其他各项资产	9,218,897.18	0.25
9	合计	3,669,752,740.41	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	55,521,472.00	1.52
B	采矿业	14,095,000.00	0.39
C	制造业	1,567,543,750.19	43.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,059,858.25	1.59
E	建筑业	24,800,992.00	0.68
F	批发和零售业	21,180,715.92	0.58
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	323,725,819.70	8.89
J	金融业	36,250,248.20	1.00

K	房地产业	97,124,477.88	2.67
L	租赁和商务服务业	75,993,050.00	2.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,166,170.00	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	80,346,867.54	2.21
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,367,808,421.68	65.01

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 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	600406	国电南瑞	7,403,100	137,179,443.00	3.77
2	000002	万科A	4,077,434	97,124,477.88	2.67
3	300760	迈瑞医疗	787,225	85,980,714.50	2.36
4	601877	正泰电器	3,346,499	81,119,135.76	2.23
5	300628	亿联网络	1,035,575	80,422,754.50	2.21
6	600763	通策医疗	1,692,582	80,346,867.54	2.21
7	002821	凯莱英	1,029,473	69,849,743.05	1.92
8	600872	中炬高新	2,255,918	66,459,344.28	1.82
9	300529	健帆生物	1,594,924	66,189,346.00	1.82
10	603899	晨光文具	2,168,661	65,601,995.25	1.80

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	000651	格力电器	380,501,526.16	21.66
2	600519	贵州茅台	355,302,290.09	20.22
3	603799	华友钴业	333,134,984.10	18.96
4	601318	中国平安	318,237,312.13	18.11
5	601888	中国国旅	316,352,777.95	18.00
6	600036	招商银行	308,143,374.37	17.54



7	002304	洋河股份	258,292,276.49	14.70
8	601155	新城控股	229,566,320.91	13.07
9	002027	分众传媒	228,357,274.84	13.00
10	000661	长春高新	224,032,774.24	12.75
11	000568	泸州老窖	222,848,372.26	12.68
12	600585	海螺水泥	221,243,691.80	12.59
13	601012	隆基股份	213,350,286.28	12.14
14	600872	中炬高新	205,599,801.18	11.70
15	002142	宁波银行	197,879,023.29	11.26
16	600809	山西汾酒	196,149,131.24	11.16
17	601939	建设银行	190,448,590.71	10.84
18	600690	青岛海尔	185,012,924.36	10.53
19	002007	华兰生物	177,499,711.67	10.10
20	601601	中国太保	171,116,279.57	9.74
21	600438	通威股份	166,669,507.26	9.49
22	300365	恒华科技	163,880,138.40	9.33
23	000002	万科A	163,624,212.17	9.31
24	002236	大华股份	151,210,809.08	8.61
25	600763	通策医疗	144,032,295.97	8.20
26	600030	中信证券	143,778,942.95	8.18
27	300529	健帆生物	143,168,846.92	8.15
28	600176	中国巨石	142,087,105.30	8.09
29	300618	寒锐钴业	141,185,609.10	8.04
30	002507	涪陵榨菜	140,897,530.72	8.02
31	600406	国电南瑞	140,128,417.00	7.97
32	002179	中航光电	138,307,016.62	7.87
33	000596	古井贡酒	135,199,610.33	7.69
34	300122	智飞生物	132,900,434.84	7.56
35	000860	顺鑫农业	126,826,618.93	7.22
36	600887	伊利股份	126,435,994.29	7.20
37	002078	太阳纸业	124,698,695.69	7.10
38	300347	泰格医药	120,243,593.15	6.84
39	600486	扬农化工	119,356,203.28	6.79
40	002258	利尔化学	118,424,661.18	6.74
41	300003	乐普医疗	117,036,323.53	6.66
42	002475	立讯精密	116,711,651.52	6.64
43	600027	华电国际	116,501,490.79	6.63
44	000786	北新建材	115,034,668.94	6.55
45	000830	鲁西化工	113,879,643.47	6.48
46	600104	上汽集团	111,871,738.34	6.37
47	600801	华新水泥	110,048,132.12	6.26
48	300296	利亚德	109,468,914.91	6.23

49	300628	亿联网络	108,220,754.78	6.16
50	601186	中国铁建	105,111,930.83	5.98
51	300760	迈瑞医疗	105,025,596.75	5.98
52	300451	创业慧康	104,528,442.69	5.95
53	002821	凯莱英	102,929,701.23	5.86
54	002912	中新赛克	102,813,263.60	5.85
55	600340	华夏幸福	102,375,216.62	5.83
56	002916	深南电路	101,942,110.55	5.80
57	002396	星网锐捷	100,536,269.27	5.72
58	600884	杉杉股份	100,130,830.67	5.70
59	601877	正泰电器	97,055,096.71	5.52
60	000338	潍柴动力	94,557,559.20	5.38
61	300073	当升科技	93,964,153.24	5.35
62	002262	恩华药业	90,732,272.17	5.16
63	603369	今世缘	90,310,064.32	5.14
64	603899	晨光文具	90,111,650.80	5.13
65	300567	精测电子	89,591,349.56	5.10
66	600009	上海机场	88,662,717.15	5.05
67	300571	平治信息	88,547,635.64	5.04
68	002138	顺络电子	86,346,707.17	4.91
69	002353	杰瑞股份	83,723,897.96	4.76
70	002460	赣锋锂业	82,939,802.88	4.72
71	000858	五粮液	81,727,037.25	4.65
72	002463	沪电股份	80,846,658.77	4.60
73	601336	新华保险	79,693,143.99	4.54
74	600309	万华化学	79,573,421.03	4.53
75	300630	普利制药	79,045,939.12	4.50
76	300036	超图软件	78,821,891.92	4.49
77	600566	济川药业	78,553,156.92	4.47
78	601857	中国石油	77,722,329.19	4.42
79	600048	保利地产	77,031,341.53	4.38
80	300398	飞凯材料	77,025,427.07	4.38
81	300559	佳发教育	75,409,564.65	4.29
82	002299	圣农发展	74,304,475.96	4.23
83	002008	大族激光	74,141,075.41	4.22
84	002032	苏泊尔	73,240,179.31	4.17
85	603826	坤彩科技	72,792,409.21	4.14
86	300146	汤臣倍健	71,727,174.28	4.08
87	603589	口子窖	70,129,855.19	3.99
88	600426	华鲁恒升	69,953,245.89	3.98
89	300047	天源迪科	69,789,862.05	3.97
90	000977	浪潮信息	68,732,980.14	3.91

91	002035	华帝股份	67,832,294.48	3.86
92	601231	环旭电子	67,149,948.14	3.82
93	300595	欧普康视	66,845,532.44	3.80
94	002815	崇达技术	65,672,049.74	3.74
95	300015	爱尔眼科	65,508,572.00	3.73
96	601111	中国国航	65,359,947.33	3.72
97	600660	福耀玻璃	64,548,136.43	3.67
98	603605	珀莱雅	63,403,426.72	3.61
99	002466	天齐锂业	63,202,892.65	3.60
100	002410	广联达	63,063,767.65	3.59
101	002202	金风科技	61,855,019.16	3.52
102	603848	好太太	58,779,572.81	3.35
103	002050	三花智控	58,577,075.23	3.33
104	600803	新奥股份	57,296,295.25	3.26
105	300274	阳光电源	57,085,368.64	3.25
106	300498	温氏股份	57,066,583.08	3.25
107	000932	华菱钢铁	56,691,665.55	3.23
108	300531	优博讯	54,814,600.18	3.12
109	300316	晶盛机电	54,733,187.07	3.11
110	600779	水井坊	54,707,131.48	3.11
111	600900	长江电力	53,700,074.30	3.06
112	603043	广州酒家	53,103,720.19	3.02
113	002717	岭南股份	53,053,914.74	3.02
114	002419	天虹股份	52,535,449.78	2.99
115	300476	胜宏科技	50,287,729.76	2.86
116	002415	海康威视	49,501,876.93	2.82
117	002859	洁美科技	49,124,051.24	2.80
118	300590	移为通信	47,837,540.56	2.72
119	300144	宋城演艺	47,651,958.45	2.71
120	300408	三环集团	46,159,106.27	2.63
121	300577	开润股份	45,672,792.31	2.60
122	300232	洲明科技	43,808,423.29	2.49
123	300271	华宇软件	43,744,635.81	2.49
124	300633	开立医疗	43,600,556.59	2.48
125	603638	艾迪精密	43,202,206.72	2.46
126	300253	卫宁健康	43,185,637.14	2.46
127	300523	辰安科技	43,127,387.24	2.45
128	002422	科伦药业	42,984,537.79	2.45
129	300308	中际旭创	42,763,115.54	2.43
130	601166	兴业银行	41,796,073.31	2.38
131	300170	汉得信息	41,696,954.66	2.37
132	000089	深圳机场	41,524,415.42	2.36

133	300725	药石科技	41,413,023.95	2.36
134	603660	苏州科达	41,222,623.31	2.35
135	300450	先导智能	40,613,670.13	2.31
136	002376	新北洋	40,332,775.05	2.30
137	300107	建新股份	40,282,114.20	2.29
138	600867	通化东宝	40,241,707.01	2.29
139	600031	三一重工	39,255,421.37	2.23
140	002511	中顺洁柔	39,177,710.65	2.23
141	601128	常熟银行	39,008,641.22	2.22
142	300662	科锐国际	38,851,061.96	2.21
143	603659	璞泰来	38,831,490.76	2.21
144	001979	招商蛇口	38,784,016.77	2.21
145	600346	恒力股份	38,775,289.74	2.21
146	600197	伊力特	38,747,344.58	2.21
147	603368	柳药股份	38,734,252.90	2.20
148	600332	白云山	38,609,243.85	2.20
149	002127	南极电商	38,598,466.47	2.20
150	603156	养元饮品	38,461,592.32	2.19
151	603658	安图生物	38,420,675.97	2.19
152	000963	华东医药	38,331,719.12	2.18
153	603113	金能科技	38,227,205.33	2.18
154	600276	恒瑞医药	37,892,769.04	2.16
155	603866	桃李面包	37,733,702.18	2.15
156	603466	风语筑	37,687,863.89	2.14
157	300673	佩蒂股份	37,482,061.62	2.13
158	603365	水星家纺	37,475,337.27	2.13
159	000333	美的集团	37,428,045.59	2.13
160	002600	领益智造	37,376,397.33	2.13
161	600703	三安光电	37,309,177.70	2.12
162	002589	瑞康医药	37,283,547.52	2.12
163	603018	中设集团	37,050,323.98	2.11
164	300136	信维通信	37,038,652.68	2.11
165	300596	利安隆	37,029,176.79	2.11
166	300124	汇川技术	37,008,266.56	2.11
167	300037	新宙邦	36,876,376.54	2.10
168	300014	亿纬锂能	36,831,568.85	2.10
169	002812	恩捷股份	36,670,911.37	2.09
170	000543	皖能电力	36,608,163.18	2.08
171	601766	中国中车	36,518,907.44	2.08
172	002614	奥佳华	36,321,521.51	2.07
173	600507	方大特钢	35,799,312.21	2.04
174	300724	捷佳伟创	35,422,394.12	2.02

175	601229	上海银行	35,252,090.01	2.01
-----	--------	------	---------------	------

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。

#### 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	601318	中国平安	423,148,350.97	24.08
2	600519	贵州茅台	367,374,622.14	20.91
3	000651	格力电器	357,658,418.33	20.36
4	603799	华友钴业	300,517,965.31	17.10
5	600036	招商银行	292,474,419.85	16.65
6	601888	中国国旅	291,371,630.77	16.58
7	002027	分众传媒	256,157,055.37	14.58
8	002142	宁波银行	226,302,473.73	12.88
9	002304	洋河股份	226,234,151.76	12.88
10	600438	通威股份	224,839,676.59	12.80
11	601155	新城控股	214,639,276.42	12.22
12	000661	长春高新	207,516,289.37	11.81
13	600585	海螺水泥	205,500,531.88	11.70
14	600690	青岛海尔	192,826,449.41	10.97
15	600809	山西汾酒	191,840,236.57	10.92
16	600176	中国巨石	185,942,195.89	10.58
17	000568	泸州老窖	183,283,476.98	10.43
18	002007	华兰生物	177,360,504.73	10.09
19	601939	建设银行	168,748,661.44	9.60
20	000858	五粮液	165,425,256.93	9.41
21	601601	中国太保	165,034,300.82	9.39
22	000830	鲁西化工	162,235,109.12	9.23
23	601012	隆基股份	151,098,169.46	8.60
24	002236	大华股份	150,156,130.06	8.55
25	600872	中炬高新	146,248,510.29	8.32
26	000786	北新建材	143,230,166.64	8.15
27	300365	恒华科技	143,197,666.59	8.15
28	600030	中信证券	142,208,959.46	8.09
29	002078	太阳纸业	142,060,082.69	8.08
30	000596	古井贡酒	141,554,890.28	8.06
31	300618	寒锐钴业	138,154,756.88	7.86
32	000860	顺鑫农业	136,016,280.61	7.74
33	002507	涪陵榨菜	133,787,848.82	7.61
34	002179	中航光电	128,814,420.88	7.33

35	300122	智飞生物	122,799,142.22	6.99
36	600887	伊利股份	116,016,027.93	6.60
37	002475	立讯精密	111,292,265.81	6.33
38	600486	扬农化工	111,064,167.71	6.32
39	300296	利亚德	109,444,141.30	6.23
40	002258	利尔化学	108,739,778.33	6.19
41	300347	泰格医药	108,213,675.90	6.16
42	603369	今世缘	107,960,342.51	6.14
43	600104	上汽集团	107,452,511.39	6.12
44	600801	华新水泥	106,074,822.15	6.04
45	002916	深南电路	103,645,688.67	5.90
46	600048	保利地产	100,624,904.35	5.73
47	300003	乐普医疗	99,058,434.30	5.64
48	300567	精测电子	96,362,720.42	5.48
49	000338	潍柴动力	90,519,894.63	5.15
50	600884	杉杉股份	90,045,656.17	5.12
51	600340	华夏幸福	88,659,061.35	5.05
52	603589	口子窖	86,298,446.47	4.91
53	600009	上海机场	85,128,779.12	4.84
54	002460	赣锋锂业	85,061,962.83	4.84
55	002262	恩华药业	84,227,130.58	4.79
56	002035	华帝股份	84,158,855.29	4.79
57	002463	沪电股份	83,902,088.97	4.78
58	002912	中新赛克	83,584,378.85	4.76
59	002138	顺络电子	82,185,402.39	4.68
60	601186	中国铁建	80,622,553.97	4.59
61	600566	济川药业	80,190,509.23	4.56
62	300036	超图软件	79,943,009.22	4.55
63	300529	健帆生物	78,943,454.32	4.49
64	002353	杰瑞股份	76,250,317.76	4.34
65	600309	万华化学	75,702,750.31	4.31
66	000977	浪潮信息	74,865,464.11	4.26
67	601857	中国石油	74,603,155.50	4.25
68	300398	飞凯材料	73,886,154.53	4.21
69	300571	平治信息	73,280,925.46	4.17
70	300630	普利制药	72,456,145.97	4.12
71	600027	华电国际	72,455,738.07	4.12
72	300595	欧普康视	71,275,361.60	4.06
73	300047	天源迪科	70,593,510.31	4.02
74	300316	晶盛机电	70,229,814.57	4.00
75	002714	牧原股份	70,202,948.16	4.00
76	600779	水井坊	70,002,589.44	3.98

77	601231	环旭电子	67,766,891.66	3.86
78	300146	汤臣倍健	66,768,806.32	3.80
79	002008	大族激光	66,699,636.45	3.80
80	601111	中国国航	62,565,821.59	3.56
81	300015	爱尔眼科	61,617,693.80	3.51
82	002396	星网锐捷	60,489,530.36	3.44
83	002815	崇达技术	60,415,717.08	3.44
84	601336	新华保险	59,641,519.27	3.39
85	002410	广联达	59,501,523.95	3.39
86	600426	华鲁恒升	58,913,527.01	3.35
87	000002	万科A	58,546,553.03	3.33
88	603848	好太太	57,496,916.85	3.27
89	600763	通策医疗	57,172,296.84	3.25
90	002466	天齐锂业	57,072,265.07	3.25
91	002202	金风科技	56,846,673.03	3.24
92	002050	三花智控	56,757,950.72	3.23
93	300498	温氏股份	56,751,367.35	3.23
94	000932	华菱钢铁	55,842,753.44	3.18
95	600660	福耀玻璃	55,499,959.92	3.16
96	300451	创业慧康	55,083,121.33	3.13
97	002419	天虹股份	54,050,959.53	3.08
98	600346	恒力股份	52,061,508.61	2.96
99	600900	长江电力	51,594,542.16	2.94
100	300476	胜宏科技	51,032,392.10	2.90
101	600803	新奥股份	50,796,315.15	2.89
102	300073	当升科技	50,371,987.49	2.87
103	002717	岭南股份	49,349,129.28	2.81
104	603365	水星家纺	48,986,267.86	2.79
105	600867	通化东宝	47,116,356.96	2.68
106	600332	白云山	46,587,876.08	2.65
107	002415	海康威视	46,400,690.70	2.64
108	002859	洁美科技	46,043,813.92	2.62
109	300408	三环集团	45,645,144.07	2.60
110	002032	苏泊尔	45,024,494.03	2.56
111	300308	中际旭创	44,344,220.29	2.52
112	300357	我武生物	44,017,717.15	2.51
113	300170	汉得信息	43,909,413.28	2.50
114	603466	风语筑	43,883,161.20	2.50
115	300144	宋城演艺	43,430,659.72	2.47
116	601166	兴业银行	41,902,905.08	2.38
117	300450	先导智能	41,795,920.45	2.38
118	603638	艾迪精密	41,652,643.18	2.37

119	600487	亨通光电	41,368,865.44	2.35
120	300232	洲明科技	41,036,757.87	2.34
121	600183	生益科技	40,465,576.90	2.30
122	601128	常熟银行	40,297,565.31	2.29
123	603156	养元饮品	39,357,781.85	2.24
124	000089	深圳机场	39,093,215.28	2.22
125	300523	辰安科技	38,953,489.38	2.22
126	600507	方大特钢	38,876,645.98	2.21
127	300633	开立医疗	38,716,883.45	2.20
128	300274	阳光电源	38,622,439.45	2.20
129	600031	三一重工	38,123,367.28	2.17
130	000963	华东医药	37,427,191.50	2.13
131	002127	南极电商	37,395,025.95	2.13
132	300107	建新股份	37,267,872.92	2.12
133	002422	科伦药业	36,960,065.48	2.10
134	300628	亿联网络	36,953,721.09	2.10
135	603866	桃李面包	36,950,148.67	2.10
136	300577	开润股份	36,060,383.55	2.05
137	603368	柳药股份	35,822,558.48	2.04
138	300014	亿纬锂能	35,654,222.25	2.03
139	601229	上海银行	35,209,805.90	2.00

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。

#### 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	18,644,755,646.04
卖出股票收入(成交)总额	16,753,558,614.43

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。

#### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	290,616,000.00	7.98
	其中:政策性金融债	290,616,000.00	7.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-



6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,995,610.84	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	295,611,610.84	8.12

## 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	180312	18 进出 12	2,000,000	200,460,000.00	5.50
2	180404	18 农发 04	600,000	60,150,000.00	1.65
3	160301	16 进出 01	300,000	30,006,000.00	0.82
4	113011	光大转债	20,000	2,102,400.00	0.06
5	128046	利尔转债	16,141	1,600,218.74	0.04

## 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 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，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	2,077,466.59
2	应收证券清算款	432,730.46
3	应收股利	-
4	应收利息	4,939,257.27
5	应收申购款	1,769,442.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,218,897.18

### 8.12.4 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	113011	光大转债	2,102,400.00	0.06
2	113013	国君转债	476,012.40	0.01
3	132010	17 桐昆 EB	250,027.50	0.01
4	127006	敖东转债	959.30	0.00

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额	持有人	户均持有	持有人结构
----	-----	------	-------

级别	户数(户)	的基金份额	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 (%)
南方新优享 A	774, 294	2, 248. 24	473, 492, 621. 79	27. 20	1, 267, 305, 172. 63	72. 80
南方新优享 C	40	221. 81	-	-	8, 872. 30	100. 00
合计	774, 334	2, 248. 13	473, 492, 621. 79	27. 20	1, 267, 314, 044. 93	72. 80

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	南方新优享 A	3, 184, 491. 90	0. 1829
	南方新优享 C	-	-
	合计	3, 184, 491. 90	0. 1829

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方新优享 A	50~100
	南方新优享 C	-
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	南方新优享 A	-
	南方新优享 C	-
	合计	-

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方新优享 A	南方新优享 C
基金合同生效日（2014 年 2 月 26 日）基金份额总额	2,143,062,806.56	-
本报告期期初基金份额总额	693,937,333.29	-
本报告期基金总申购份额	1,887,570,063.21	8,872.30
减：本报告期基金总赎回份 额	840,709,602.08	-
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	1,740,797,794.42	8,872.30

## § 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

本基金本报告期内基金管理人，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 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(特殊普通合伙)。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 100,000.00 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

#### 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	佣金	占当期佣	

			成交总额的 比例		金 总量的比 例	
兴业证券	1	4,959,343,685.16	14.02%	4,519,460.02	14.02%	-
太平洋证 券	1	3,636,776,736.66	10.28%	3,314,200.50	10.28%	-
海通证券	2	3,358,178,932.52	9.50%	3,060,267.33	9.50%	-
中信证券	1	3,357,456,706.51	9.49%	3,059,647.95	9.49%	-
华创证券	1	2,959,195,321.65	8.37%	2,696,719.83	8.37%	-
光大证券	1	2,865,386,745.64	8.10%	2,611,203.92	8.10%	-
天风证券	1	2,796,428,674.50	7.91%	2,548,387.18	7.91%	-
招商证券	1	1,992,030,009.39	5.63%	1,815,317.93	5.63%	-
华泰证券	1	1,970,264,057.00	5.57%	1,795,504.83	5.57%	-
申万宏源	1	1,314,651,473.82	3.72%	1,198,042.26	3.72%	-
万和证券	1	1,303,493,241.21	3.69%	1,187,876.11	3.69%	-
中信建投	1	1,216,920,925.65	3.44%	1,108,982.65	3.44%	-
西南证券	1	1,115,490,352.32	3.15%	1,016,547.28	3.15%	-
长城证券	1	808,207,204.32	2.29%	736,516.80	2.29%	-
东方证券	1	504,695,606.14	1.43%	459,931.62	1.43%	-
国盛证券	1	354,855,089.80	1.00%	323,372.50	1.00%	-
国泰君安	1	350,736,697.87	0.99%	319,624.15	0.99%	-
上海证券	1	258,388,034.20	0.73%	235,469.83	0.73%	-
国都证券	1	137,104,061.43	0.39%	124,944.80	0.39%	-
瑞银证券	1	102,102,040.92	0.29%	93,043.46	0.29%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	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。

#### 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
长城证券	-	-	11,350,000,000.00	6.49%	-	-
东方证券	-	-	3,900,000,000.00	2.23%	-	-
光大证券	-	-	30,732,900,000.00	17.57%	-	-
国都证券	-	-	1,630,000,000.00	0.93%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	10,375,000,000.00	5.93%	-	-
国泰君安	-	-	6,719,000,000.00	3.84%	-	-
海通证券	1,127,709.65	100.00%	19,460,000,000.00	11.13%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	1,990,000,000.00	1.14%	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	34,880,000,000.00	19.94%	-	-

万和证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	17,700,000,000.00	10.12%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	36,170,000,000.00	20.68%	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 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

无。