

南方金砖四国指数证券投资基金

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2018年12月31日止。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方金砖四国指数证券投资基金
基金简称	南方金砖四国指数(QDII)
基金主代码	160121
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月9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	84,385,731.13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“南方金砖”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资,以实现对标指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采用指数复制法。本基金按照成份股在金砖四国指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据金砖四国指数成份股及其权重的变化进行相应调整,在保持基金资产的流动性前提下,达到有效复制标的指数的目的。本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.4%,年跟踪误差不超过5%。
业绩比较基准	人民币计价的金砖四国指数收益率×95%+人民币活期存款收益率×5%(税后)。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用综合指数复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	郭明
	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 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	布朗兄弟哈里曼银行
	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
注册地址		140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		10005

2.5 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

§ 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	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	691,654.69	7,407,108.59	249,047.26
本期利润	-4,671,189.74	23,310,156.53	12,588,844.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0512	0.2064	0.1405
本期基金份额净值增长率	-3.90%	24.36%	20.78%
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	-0.1462	-0.1563	-0.2196
期末基金资产净值	87,320,517.44	103,329,225.30	86,584,474.94
期末基金份额净值	1.035	1.077	0.866

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。

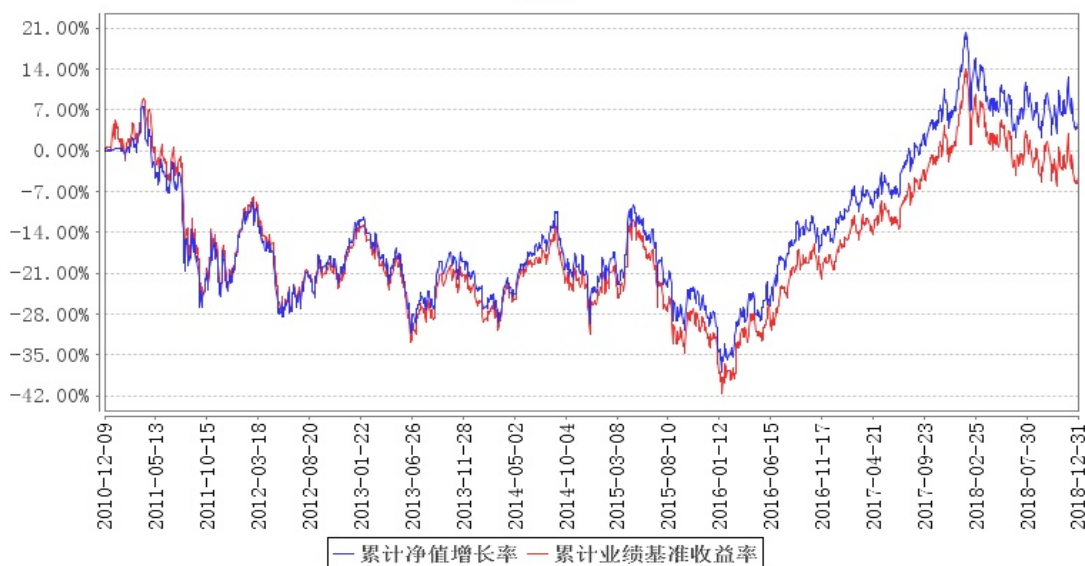
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-5.65%	1.29%	-5.83%	1.32%	0.18%	-0.03%
过去六个月	-2.08%	1.12%	-3.64%	1.15%	1.56%	-0.03%
过去一年	-3.90%	1.12%	-6.10%	1.14%	2.20%	-0.02%
过去三年	44.35%	1.02%	40.47%	1.04%	3.88%	-0.02%
过去五年	30.52%	1.09%	23.87%	1.10%	6.65%	-0.01%
自基金合同生效起至今	5.52%	1.13%	-4.52%	1.15%	10.04%	-0.02%

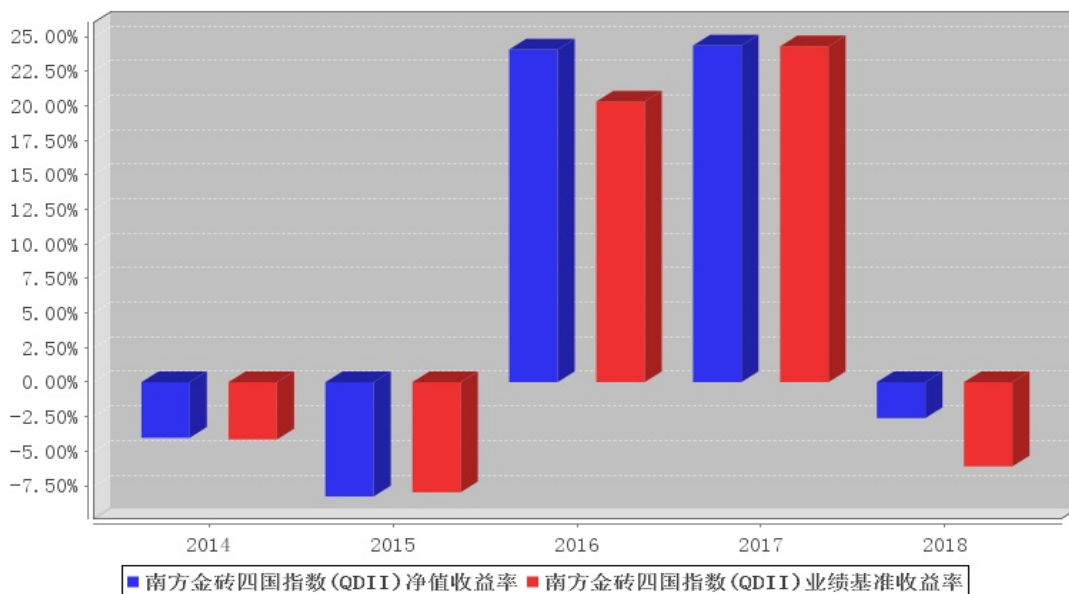
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方金砖四国指数(QDII)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 过去五年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

南方金砖四国指数(QDII)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 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：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		
黄亮	本基金基金经理	2010年12月9日	-	17	北京大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾任职于招商证券股份有限公司、天华投资有限责任公司，2005年加入南方基金国际业务部，现任国际业务部总经理、国际投资决策委员会委员；2007年9月至2009年5月，担任南方全球基金经理助理；2011年9月至2015年5月，任南方中国中小盘基金经理；2015年5月至2017年11月，任南方香港优选基金经理；2009年6月至今，担任南方全球基金经理；2010年12月至今，任南方金砖基金经理；2016年6月至今，任南方原油基金经理；2017年

					4月至今，任国企精明基金经理； 2017年10月至今，任美国 REIT基金经理。
--	--	--	--	--	--

注:1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和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。

4.3.3 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 年在全球经济增速超预期下滑、中美贸易战悬而未决、美联储四次加息、中国深化金融去杠杆的背景下，全球股市年初冲高后一路走弱，恐慌情绪蔓延，主要股票市场普遍出现较大比例的回调。根据 Bloomberg 的统计，发达市场 Markit 制造业 PMI 呈现趋势性下滑的走势，由 2017 年 12 月的 56.2 回落至 2018 年 11 月的 52.8；其中美国 Markit 制造业 PMI 一枝独秀，全年均值保持在 55.0 以上，但下行压力开始逐步显现；新兴市场 Markit 制造业 PMI 由 2017 年 12 月的 52.2 回落至 2018 年 11 月的 50.8。从市场风格上来看，成长类个股全年跑赢价值类个股，但 2018 年年末以美国科技股为代表的成长股出现了一轮比较剧烈的回调。按美元计价全收益口径计算，MSCI 全球价值指数下跌 10.07%，MSCI 全球成长指数下跌 6.41%。 报告期间，MSCI 发达国家指数按美元计价下跌 10.44%，MSCI 新兴市场指数按美元计价下跌 16.64%，恒生指数按港币计价下跌 13.61%，黄金价格按美元计价下跌 1.56%，十年期美国国债、十年期日本国债及十年期德国国债收益率分别上升 28 个基点、下降 5 个基点和下降 19 个基点。新兴市场方面，巴西圣保罗证交所指数按本币计价上涨 15.03%，印度 Nifty 指数按本币计价上涨 3.15%，俄罗斯 MOEX 指数按本币计价上涨 12.30%。美元指数上涨 4.40%，由 92.12 上升至 96.17。 港股市场方面，2018 年恒生指数下跌 13.61%，恒生国企指数下跌 13.53%。从市值角度来看，港股出现普遍下跌的市场格局，恒生大型股指数下跌 15.15%，恒生中型股指数下跌 23.97%，恒生小型股指数下跌 17.34%。根据 Wind 统计，2018 年港股通南下资金累计净买入 924 亿元人民币，相比 2017 年的 3065 亿元人民币大幅减少。恒生 AH 股溢价指数于报告期内显著回落，由 130.35 点下降至 117.15 点。恒生行业方面，公用事业、能源和电讯行业表现较好，分别跑赢恒生指数 14.86%、10.78%和 10.23%，表现较差的资讯科技、原材料和消费品制造板块分别落后 15.95%、15.91%和 13.50%。 本基金总体保持仓位平稳，基金根据各新兴市场的政局动态、宏观经济变化、产业经

济结构以及市场估值灵活进行区域与公司选择。总体上，本基金在投资策略上以价值投资为导向，遵循自上而下选择投资区域与自下而上精选个股相结合的原则，在行业中精选盈利改善、估值水平合理的行业龙头公司，尤其关注公司的技术优势、发展战略、行业成长性以及产业政策的变化。基金围绕市场估值体系重构的长期逻辑进行个股筛选，不断发掘存在估值重估机会的细分行业和个股，同时通过分散化投资控制投资组合整体的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2018 年基金净值增长-3.90%，基金基准增长-6.10%。

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，我们判断当前仍然存在多个方面的宏观因素影响市场估值和投资者情绪，包括二月底中美贸易谈判能否取得阶段性进展、美联储三月份是否会如市场预期暂缓加息、两会对于 2019 年逆周期政策的进一步明确以及市场普遍关注的宽货币政策何时能够有效向实体经济传导的问题。此外，英国脱欧进程、欧洲政治体系的走向以及高外债敞口的资源出口依赖型新兴经济体是否会出现严重危机也会影响市场对于风险资产的定价。尽管全球宏观层面存在较大的不确定性，但 G20 会议上中美贸易问题出现了一定的转机，缓解了中国面临的外部压力，叠加国内相应的政策不断落地，我们认为中国经济大概率在 2019 年出现触底回升，因此，我们认为新兴市场中适当超配中资股拥有较高的风险收益比。本基金在配置过程中也兼顾流动性、市场风格转换及调仓成本等其他相关因素，努力控制基金的回撤水平，力争战胜业绩比较基准，为投资者创造持续稳健的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，并积极开展形式丰富的合规培训与考试，加强员工行为规范检查、加大合规问责力度，强化全员合规、主动合规理念；对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务开展了定期稽核、专项稽核及多项自查，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，排查业务中的风险点并完善内控措施，促进公司业务合规运作、稳健经营；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；积极参与新产品、新业务合规评估工作，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促持续落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；继续按照风险为本的

原则积极开展各项反洗钱工作，进一步升级反洗钱业务系统，优化其他反洗钱资源配置，重点推进《法人金融机构洗钱和恐怖融资风险管理指引（试行）》的具体落实工作，加强业务部门反洗钱风险评估频率，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

4.7 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。

4.8 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，每一基金份额享有同等分配权；基金收益分配后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，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，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；在符合上述基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多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%；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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。

4.9 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金砖四国指数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，南方金砖四国指数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金砖四国指数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，南方金砖四国指数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金砖四国指数证券投资基金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23202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：南方金砖四国指数证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末	上年度末
----	-----	------

	2018年12月31日	2017年12月31日
资产:		
银行存款	6,816,033.42	6,996,430.88
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	81,774,349.53	96,939,239.95
其中: 股票投资	81,774,349.53	96,939,239.95
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	173.56	747.91
应收股利	162,287.29	240,137.94
应收申购款	149,780.69	350,668.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	88,902,624.49	104,527,225.58
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2018年12月31日	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	-	-
应付证券清算款	725,368.97	3.49
应付赎回款	334,040.22	675,351.10
应付管理人报酬	60,147.41	70,393.93
应付托管费	18,796.06	21,998.11
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	73,259.59	53,185.25
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	370,494.80	377,068.40
负债合计	1,582,107.05	1,198,000.28
所有者权益:		
实收基金	84,385,731.13	95,899,300.16
未分配利润	2,934,786.31	7,429,925.14
所有者权益合计	87,320,517.44	103,329,225.30

负债和所有者权益总计	88,902,624.49	104,527,225.58
------------	---------------	----------------

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.035 元，基金份额总额 84,385,731.13 份。

7.2 利润表

会计主体：南方金砖四国指数证券投资基金

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	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-2,875,944.21	25,282,187.54
1. 利息收入	22,941.26	29,836.97
其中：存款利息收入	22,941.26	29,836.97
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	2,043,444.19	9,539,615.28
其中：股票投资收益	-850,771.09	6,552,728.21
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	2,894,215.28	2,986,887.07
3. 公允价值变动收益	-5,362,844.43	15,903,047.94
4. 汇兑收益	347,046.29	-275,478.64
5. 其他收入	73,468.48	85,165.99
减：二、费用	1,795,245.53	1,972,031.01
1. 管理人报酬	793,146.03	873,720.81
2. 托管费	247,858.08	273,037.78
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	133,600.08	210,699.59
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	620,641.34	614,572.83
三、利润总额	-4,671,189.74	23,310,156.53
减：所得税费用	-	-
四、净利润	-4,671,189.74	23,310,156.53

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方金砖四国指数证券投资基金

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）	95,899,300.16	7,429,925.14	103,329,225.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-4,671,189.74	-4,671,189.74
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）	-11,513,569.03	176,050.91	-11,337,518.12
其中：1. 基金申购款	51,185,815.45	5,916,909.16	57,102,724.61
2. 基金赎回款	-62,699,384.48	-5,740,858.25	-68,440,242.73
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）	84,385,731.13	2,934,786.31	87,320,517.44
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）	99,941,395.30	-13,356,920.36	86,584,474.94
二、本期经营活	-	23,310,156.53	23,310,156.53

动产生的基金净值变动数(本期净利润)			
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)	-4,042,095.14	-2,523,311.03	-6,565,406.17
其中:1.基金申购款	90,348,303.98	-4,399,078.03	85,949,225.95
2.基金赎回款	-94,390,399.12	1,875,767.00	-92,514,632.12
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)	95,899,300.16	7,429,925.14	103,329,225.30

注: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

南方金砖四国指数证券投资基金(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[2010]592号《关于核准南方金砖四国指数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《南方金砖四国指数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636,361,305.76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(2010)第379号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方金砖四国指数证券投资基金基金合同》于2010年12月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为636,543,203.98份基金份额,其中认购资金利息折合181,898.22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，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《南方金砖四国指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于全球证券市场中的金砖四国指数的成份股(包括股票和/或存托凭证)、备选成份股、新股(一级市场首次发行或增发)。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括在证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、ETF基金、权证、结构性投资产品、金融衍生产品、银行存款、短期政府债券等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中金砖四国指数成份股及备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的85%，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。本基金的业绩比较基准为：人民币计价的金砖四国指数收益率 \times 95%+人民币活期存款收益率 \times 5%(税后)。

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》、《南方金砖四国指数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相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12月31日的财务状况以及2018年度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

7.4.4.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.5 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》及其他相关境内外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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所

上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 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、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
布朗兄弟哈里曼银行 (“Brown Brothers Harriman & Co.”)	境外资产托管人
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
华泰金融控股(香港)有限公司(“华泰香港”)	基金管理人的股东华泰证券的子公司
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。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年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 (%)
华泰证券	1,537,997.10	2.16	158,800.00	0.15

华泰香港	4,614,223.43	6.47	7,279,423.84	6.91
------	--------------	------	--------------	------

7.4.7.1.2 权证交易

注:无。

7.4.7.1.3 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	1,454.75	1.62	1,720.35	2.35
华泰香港	5,537.07	6.18	-	-
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 (%)
华泰香港	8,735.31	7.14	-	-
华泰证券	117.77	0.10	265.60	0.50

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 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	793,146.03	873,720.81
其中:支付销售机构的客户维护费	208,009.12	228,675.79

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0.80%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×0.80% / 当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年	上年度可比期间 2017年1月1日至
----	-----------------------	-----------------------

	12月31日	2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	247,858.08	273,037.78

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。

7.4.7.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 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
基金合同生效日（2010年12月9日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	20,000,400.00	20,000,400.00
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	20,000,400.00	20,000,400.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	23.70%	20.86%

7.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

7.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年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	897,563.97	22,013.79	2,473,512.79	28,537.41
布朗兄弟哈里曼 银行	5,918,469.45	0.01	4,522,918.09	0.01

注:本基金由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管的银行存款,按约定利率计息。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

于2018年12月31日,本基金持有909,000股中国工商银行的H股普通股,成本总额为人民币3,961,306.12元,估值总额为人民币4,452,243.82元,占基金资产净值的比例为5.10%(于2017年12月31日,本基金持有1,133,000股中国工商银行的H股普通股,成本总额为人民币4,937,469.56元,估值总额为人民币5,957,171.13元,占基金资产净值的比例为5.77%)。

7.4.8 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

注:无。

7.4.9 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81,774,349.53元，无属于第二或第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次96,939,239.95元，无第二或第三层次)。

(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、基金和债券，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、基金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、基金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	81,774,349.53	91.98
	其中：普通股	51,497,011.78	57.93
	存托凭证	30,277,337.75	34.06
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,816,033.42	7.67
8	其他各项资产	312,241.54	0.35
9	合计	88,902,624.49	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股市值为人民币 8,672,312.17 元，占基金资产净值比例 9.93%。

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	18,976,367.91	21.73
中国香港	51,497,011.78	58.97
英国	11,300,969.84	12.94

合计	81,774,349.53	93.65
----	---------------	-------

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
能源	14,295,635.70	16.37
原材料	4,326,944.11	4.96
工业	531,678.16	0.61
非必需消费品	4,848,976.93	5.55
必需消费品	1,401,496.74	1.60
医疗保健	343,610.59	0.39
金融	36,581,492.49	41.89
科技	12,962,489.45	14.84
通讯	5,993,105.76	6.86
公用事业	488,919.60	0.56
合计	81,774,349.53	93.65

注：本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

8.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

8.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	香港	44,900.00	12,353,193.32	14.15
2	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港联合交易所	香港	1,039,000.00	5,881,001.83	6.74
3	Itau Unibanco Holding SA	Banco Itau Holding Financeir	ITUB UN	美国纽约证券交易所	美国	72,950.00	4,576,127.82	5.24
4	Industrial and Commercial	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港联合交易所	香港	909,000.0	4,452,243.82	5.10

	Bank of China Limited	公司				0		
5	China Mobile Limited	中国移动有限公司	941 HK	香港联合交易所	香港	56,000.00	3,697,213.52	4.23
6	Vale SA	淡水河谷公司	VALE UN	美国纽约证券交易所	美国	40,038.00	3,624,464.29	4.15
7	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港联合交易所	香港	59,000.00	3,574,764.57	4.09
8	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	BABA US	美国纽约证券交易所	美国	3,230.00	3,038,586.40	3.48
9	Bank of China Limited	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港联合交易所	香港	985,000.00	2,917,132.66	3.34
10	LUKOIL PJSC	卢克石油公司	LKOLD LI	英国伦敦证券交易所	英国	5,532.00	2,713,897.06	3.11

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益投资明细,应阅读登载于

<http://www.nffund.com> 的年度报告正文。

8.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

注:无。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	China Mobile Limited	941 HK	3,743,676.14	3.62
2	Alibaba Group Holding Ltd	BABA US	3,610,851.38	3.49
3	Tencent Holdings Ltd	700 HK	3,511,281.19	3.40
4	Vale SA	VALE UN	3,256,255.98	3.15
5	Itau Unibanco Holding SA	ITUB UN	1,827,825.31	1.77

6	Baidu Inc	BIDU US	1,287,066.42	1.25
7	Agricultural Bank of China Limited	1288 HK	1,013,267.35	0.98
8	China Construction Bank Corporation	939 HK	879,769.93	0.85
9	Sino Biopharmaceutical Limited	1177 HK	873,910.87	0.85
10	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	861,652.20	0.83
11	Sberbank of Russia PJSC	SBER LI	674,751.13	0.65
12	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	2313 HK	663,136.10	0.64
13	Sunac China Holdings Limited	1918 HK	657,951.11	0.64
14	Banco Bradesco SA	BBD UN	528,134.33	0.51
15	Longfor Group Holdings Limited	960 HK	470,658.92	0.46
16	JD.com Inc	JD UQ	440,890.84	0.43
17	Infosys Ltd	INFY UN	427,349.27	0.41
18	Bank of China Limited	3988 HK	422,537.25	0.41
19	China Tower Corporation Limited	788 HK	421,694.59	0.41
20	LUKOIL PJSC	LKOD LI	412,969.58	0.40

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。 2、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) 填写, 不考虑相关交易费用。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位: 人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	China Mobile Limited	941 HK	4,715,677.89	4.56
2	Infosys Ltd	INFY UN	4,117,362.27	3.98

3	Tencent Holdings Ltd	700 HK	2,997,265.24	2.90
4	Vale SA	VALE UN	2,920,113.94	2.83
5	China Construction Bank Corporation	939 HK	2,168,341.13	2.10
6	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	1,748,834.37	1.69
7	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	1,512,577.79	1.46
8	ICICI Bank Ltd	IBN UN	1,441,900.06	1.40
9	Agricultural Bank of China Limited	1288 HK	1,299,127.71	1.26
10	Sberbank of Russia PJSC	SBER LI	1,281,654.86	1.24
11	LUKOIL PJSC	LKOD LI	972,019.84	0.94
12	Itau Unibanco Holding SA	ITUB UN	844,614.10	0.82
13	CNOOC Limited	883 HK	781,078.00	0.76
14	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	778,779.01	0.75
15	Gazprom PJSC	OGZD LI	767,651.06	0.74
16	Bank of China Limited	3988 HK	762,701.74	0.74
17	Ambev SA	ABEV UN	730,534.25	0.71
18	Magnit PJSC	MGNT LI	728,070.78	0.70
19	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382 HK	716,719.28	0.69
20	Sunac China Holdings Limited	1918 HK	692,945.85	0.67

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。2、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。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

买入成本(成交)总额	31,228,925.05
卖出收入(成交)总额	40,109,649.82

注:买入成本和卖出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。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注:本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	应收证券清算款	-
3	应收股利	162,287.29
4	应收利息	173.56
5	应收申购款	149,780.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	312,241.54

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.11.5.1 期末指数投资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。

8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

§ 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

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 (%)
11,009	7,665.16	20,181,652.58	23.92	64,204,078.55	76.08

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金情况

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	66,487.24	0.0788

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

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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

。

§ 10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2010年12月9日) 基金份额总额	636,543,203.98
本报告期期初基金份额总额	95,899,300.16
本报告期基金总申购份额	51,185,815.45
减:本报告期基金总赎回份额	62,699,384.48
本报告期基金拆分变动份额(份额减)	-

少以“-”填列)	
本报告期末基金份额总额	84,385,731.13

注:总申购份额含红利再投。

§ 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,本基金的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。

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

本报告期内本基金未更换会计师事务所,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60,000.00元,该审计机构已提供审计服务的连续年限为8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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比	

					例	
BOCI Securities Limited	-	2,652,299.30	3.72	2,652.30	2.96	-
First Shanghai Securities Ltd.	-	3,228,356.67	4.53	3,874.02	4.33	-
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	-	39,598,133.90	55.51	57,421.33	64.12	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	4,614,223.43	6.47	5,537.07	6.18	-
海通证券	1	19,707,564.47	27.63	18,619.59	20.79	-
华泰证券	1	1,537,997.10	2.16	1,454.75	1.62	-

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

注:无。

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20180101-20180130;20180208-20180319;20180322-20181231	20,000,400.00	-	-	20,000,400.00	23.70
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注:1、申购份额包含红利再投资和份额折算。