

南方亚洲美元收益债券型证券投资基金 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。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

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。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方亚洲美元收益债券型证券投资基金	
基金简称	南方亚洲美元收益债券（QDII）	
基金主代码	002400	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 3 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	1,596,963,814.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	南方亚洲美元债 A	南方亚洲美元债 C
下属分级基金的交 易代码	002400	002401
报告期末下属分级 基金的份额总额	1,169,850,926.27 份	427,112,888.01 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“南方亚洲美元债”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及发债主体的微观基本面，寻找各类债券的投资机会，在谨慎前提下力争实现长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将根据宏观经济、基准利率水平，分析债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，做出最佳的资产配置及风险控制。本基金采用自上而下的宏观分析和自下而上的信用分析相结合的方法，挖掘相对价值被低估的债券，构建分散化的投资组合。
业绩比较基准	美元一年银行定期存款利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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 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
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518017	100140
法定代表人		张海波	易会满

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	美国北美信托银行有限公司
	英文	The Northern Trust Company
注册地址		50 South La Salle Street, Chicago, Illinois 60603 U.S.A.
办公地址		50 South La Salle Street, Chicago, Illinois 60603 U.S.A.
邮政编码		60603

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大 厦 32-42 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

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)		2016年03月03日(基金 合同生效日)-2016年 12月31日	
	南方亚洲美 元债 A	南方亚洲美 元债 C	南方亚洲美 元债 A	南方亚洲美 元债 C	南方亚洲美 元债 A	南方亚洲美 元债 C
本期 已实 现收 益	- 57,729,188. 42	- 22,796,090. 11	112,948,336 .09	27,489,334. 11	78,483,406. 59	8,756,758.2 9
本期 利润	- 4,408,964.1 9	- 4,068,308.5 1	- 17,297,702. 44	- 19,406,807. 99	188,557,977 .16	22,599,674. 00
加权 平均 基金 份额 本期 利润	-0.0126	-0.0025	-0.0062	-0.0330	0.0582	0.0417
本期 加权 平均 净值 利润 率	-1.16%	-0.23%	-0.57%	-3.08%	5.27%	3.81%

本期 基金 份额 净值 增长 率	1.13%	0.63%	-0.94%	-1.45%	10.25%	9.83%
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 利润	56,771,085. 93	14,417,111. 35	180,816,973 .50	59,175,166. 87	133,306,041 .95	21,679,920. 43
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.0485	0.0338	0.0798	0.0700	0.0404	0.0362
期末 基金 资产 净值	1,291,657,1 91.42	465,166,968 .74	2,472,882,0 74.18	915,256,387 .62	3,642,397,5 62.32	657,878,753 .42
期末 基金 份额 净值	1.1044	1.0891	1.0921	1.0823	1.1025	1.0983
3.1. 3 累 计期 末指 标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
基金 份额 累计 净值 增长	10.44%	8.91%	9.21%	8.23%	10.25%	9.83%

率						
---	--	--	--	--	--	--

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

南方亚洲美元债 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	-2.59%	0.27%	0.45%	0.00%	-3.04%	0.27%
过去六个月	2.17%	0.29%	0.93%	0.00%	1.24%	0.29%
过去一年	1.13%	0.27%	1.84%	0.00%	-0.71%	0.27%
自基金合同生效起至今	10.44%	0.23%	5.33%	0.00%	5.11%	0.23%

南方亚洲美元债 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
过去三个月	-2.72%	0.27%	0.45%	0.00%	-3.17%	0.27%
过去六个月	1.91%	0.29%	0.93%	0.00%	0.98%	0.29%
过去一年	0.63%	0.27%	1.84%	0.00%	-1.21%	0.27%
自基金合同生效起至今	8.91%	0.23%	5.33%	0.00%	3.58%	0.23%

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

南方亚洲美元债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

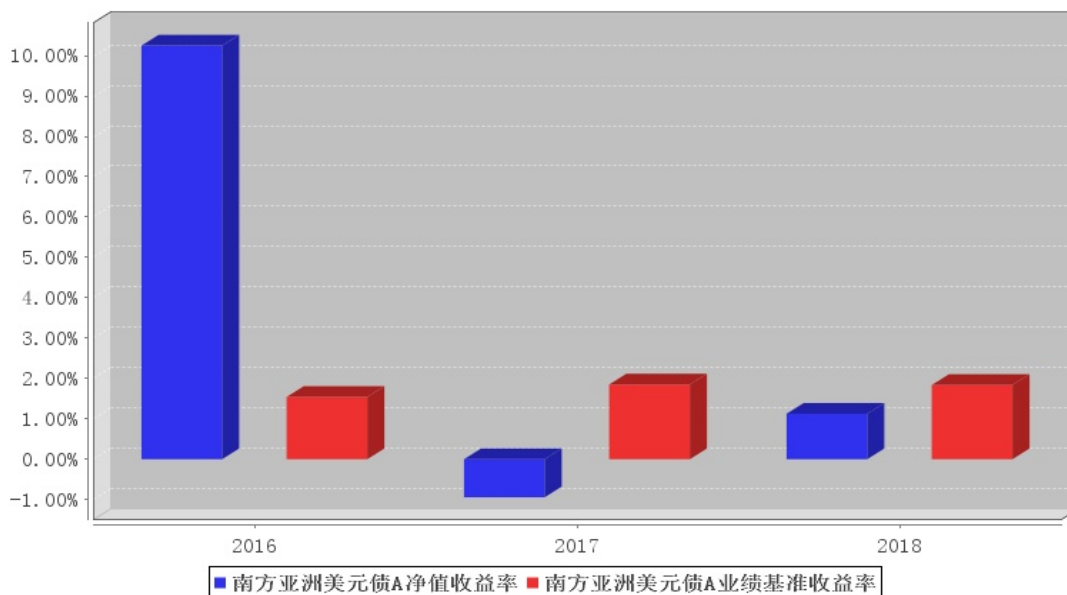


南方亚洲美元债C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

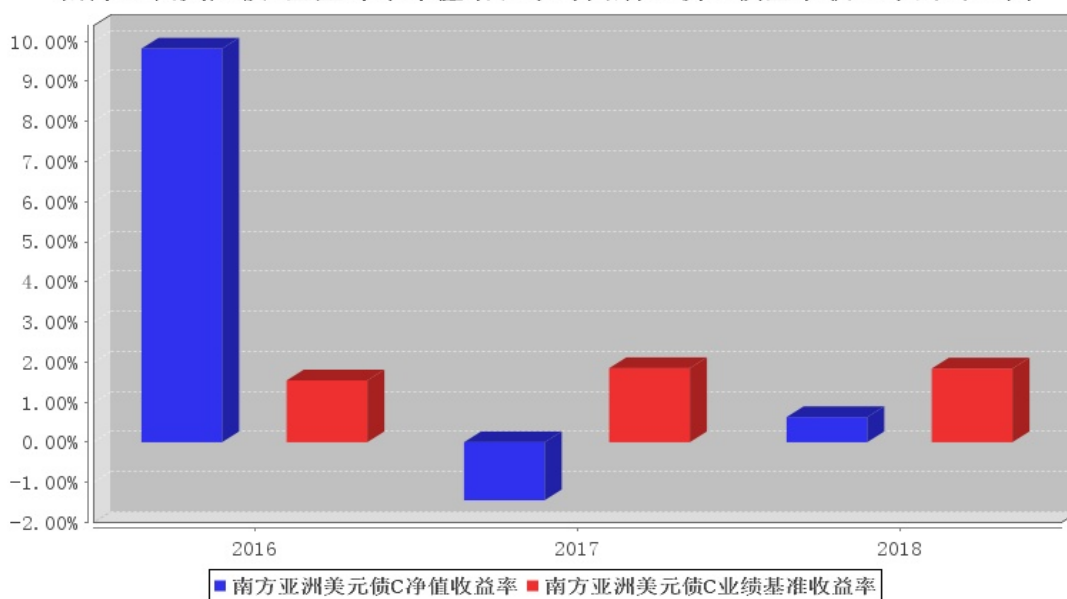


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方亚洲美元债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



南方亚洲美元债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



3.3 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		
苏炫纲	本基金基金经理	2016 年 3 月 3 日	-	16	台湾籍，美国印第安纳大学工商管理硕士，特许金融分析师（CFA），特许会计师（CPA），金融风险管理师（FRM），具有基金从业资格。11 年海外证券市场工作经验，曾任职于台湾大众银行、台湾美国商业银行、美国 Citadel Investment Group、台湾大华证券、台湾凯基证券，历任产品设计师、固定收益产品分析

					师、外汇与固定收益商品风险管理师、信用商品交易员等。2014 年 3 月加入南方基金，担任国际业务部基金经理助理；2016 年 3 月至今，任南方亚洲美元债基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------------------------------------------------------------------

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年上半年全球经济继续分化，美国经济增速位于经济周期的高点，欧洲经济增速已经出现边际放缓，新兴市场则不断动荡；随着特朗普对欧盟、加拿大和墨西哥产品加征“保护性关税”，全球贸易战继续升级，美国与主要经济体博弈逐渐深化，进一步推升了全球市场的不确定性。虽然美联储6月议息会议提升了2018年的加息次数（预计继续加息2次），但目前市场已经基本计入美联储后续加息的影响；受益于年初通胀回升预期兑现，朝鲜局势的缓和，美债利率在一季度出现上行，一度突破3.11%，但在欧央行会议鸽派表态之后，长端利率在二季度再次出现回落。期间亚洲债市也并不平静，中国区块链事件性风险频发，不少高收益债相继出现实质性违约。尤其是受到国储能源化工集团实质性违约的影响，市场避险情绪被推高，对城投债的偏好也继续下降，债市流动性随之收紧。此外，随着国内金融去杠杆政策的持续，来自央行和发改委的监管也开始趋严，对市场（汇市和债市）的扰动进一步加剧。下半年尤其是四季度，海外市场波动剧烈，期间主要资产价格的波动主要仍然受到全球因素的综合扰动。伴随着美国经济数据走弱，全球经济逐渐呈现共振下行的局面，叠加国际能源价格下行，美债收益率逐步从高位回落，尤其在12月末美联储主席鲍威尔偏鸽派表态之后，10年期美债利率一度降至3%以内（3.0-3.2%的区间下限）。期间公布的美国核心经济数据显示美国经济继续出现边际放缓迹象，固定资产投资和净出口持续走弱，目前经济韧性则主要受益于强劲的内需和偏紧的就业情况。市场最为关注的美联储12月利率决议，如期加息25个基点，却调低了未来加息路径（2019年会加息2次至2.75%-3.00%区间），长期利率下降25bps至2.75%；同时下调了经济增长和通胀的预期（2019年GDP增长率从2.5%下调至2.3%，核心PCE下调0.1%）。虽然鲍威尔继续表示目前美国经济的增长、失业率、通胀率指标仍然很好，但此次偏鸽派表态超出市场预期。期间欧央行和日

本央行仍旧按兵不动，维持原有政策利率。 利率期货隐含的加息次数显示美联储加息速度出现进一步放缓，市场对于未来加息的预期也已经发生转向，美联储加息周期已经处于末端，如果美国经济进一步走弱，美联储甚至有可能在 2019 年年中暂停加息。 在美联储全年收紧货币政策，美元持续回流的背景下，叠加四季度末海外假期因素，市场流动性并未出现明显改善，美债基准利率下行有利于利率端的改善，利率债和多数投资级标的直接受益；考虑到利率端对信用端的传导以及中资高收益民企的信用风险事件频发，信用端的全面改善仍然需要时间。 估值层面，目前债市信用利差已经接近 5-7 年的相对高位，存在进一步收窄和估值修复的空间，债市吸引力较高。 基金的操作上，南方亚洲美元债报告期内继续保持稳健的投资风格，即使面临利率和信用风险的双重影响，美元债基金整体运作继续保持平稳，增加了对此前估值已经经过调整的优质标的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金 A 份额净值为 1.1044 元、C 份额净值为 1.0891。报告期内净值上涨分别为 1.13%、0.63%，同期业绩基准为 1.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，预计 2019 年市场不确定性仍然较高，受到包括英国脱欧、意大利债务、新兴市场动荡等事件性扰动因素，这些都会影响宏观经济和汇率走势。随着全球经济共振下行和国际油价持续走弱，市场对于通胀的预期继续回落，叠加美联储政策态度也开始转向，加息的频率和概率都预计进一步下滑，全球地缘政治事件和权益资产波动也逐步加剧，市场避险情绪逐渐升温，市场环境整体都会有利于债市的表现，也对固定收益产品提供有利支撑。考虑到短端流动性尚未改善，叠加境内再融资和违约风险仍然偏高，对信用端的传导可能会需要较长时间，因此 2019 年上半年债市操作仍然保持谨慎。

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，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展情况，坚持从保护基金持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础”的合规理念，继续致力于合规与内控机制的完善，积极推动主动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

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。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

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，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；基金收益分配币种与其对应份额的认购/申购币种相同；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；美元认购/申购份额的红利再投资按所对应的美元折算净值为基准计算；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人民币基金份额净值减去每单位该类别基金份额收益分配金额后不能低于人民币份额面值，但对于美元份额，由于汇率因素影响，存在收益分配后美元份额的基金份额净值低于对应的基金份额面值的可能；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份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。

4.9 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亚洲美元收益债券型基金（QDII）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，南方亚洲美元收益债券型基金（QDII）的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方亚洲美元收益债券型基金（QDII）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，南方亚洲美元收益债券型基金（QDII）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亚洲美元收益债券型基金

（QDII）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 23078 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：南方亚洲美元收益债券型证券投资基金

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
资产：		
银行存款	134,262,032.74	293,042,405.12
结算备付金	-	-
存出保证金	31,789,088.91	33,770,246.44
交易性金融资产	1,572,999,501.18	3,056,399,208.25
其中：股票投资	-	-
基金投资	22,648,560.00	124,542,153.60
债券投资	1,550,350,941.18	2,931,857,054.65
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	18,813,381.40	70,446.84
应收利息	18,867,346.48	33,368,762.73
应收股利	205,840.20	-
应收申购款	113,790.17	4,140,493.40
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,777,050,981.08	3,420,791,562.78
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	-	-
应付赎回款	17,528,759.38	28,694,362.27
应付管理人报酬	1,219,127.42	2,443,431.29
应付托管费	335,260.04	671,943.64
应付销售服务费	201,423.54	399,207.55
应付交易费用	-	-
应交税费	248,687.85	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	693,562.69	444,156.23
负债合计	20,226,820.92	32,653,100.98
所有者权益：		
实收基金	1,596,963,814.28	3,110,262,751.10
未分配利润	159,860,345.88	277,875,710.70
所有者权益合计	1,756,824,160.16	3,388,138,461.80
负债和所有者权益总计	1,777,050,981.08	3,420,791,562.78

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,596,963,814.28 份，其中南方亚洲美元收益债券型证券投资基金 A 类(人民币)基金份额总额为 446,958,357.53 份，基金份额净值

1.1044 元；南方亚洲美元收益债券型证券投资基金 A 类(美元现汇)基金份额总额为

722,892,568.74 份，基金份额净值 0.1609 元；南方亚洲美元收益债券型证券投资基金 C 类(人民币)基金份额总额为 122,592,097.33 份，基金份额净值 1.0891 元；南方亚洲美元收益债券型证券投资基金 C 类(美元现汇)基金份额总额为 304,520,790.68 份，基金份额净值 0.1587 元。

7.2 利润表

会计主体：南方亚洲美元收益债券型证券投资基金

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	21,694,069.13	11,475,589.19
1. 利息收入	113,006,595.56	178,468,192.44
其中：存款利息收入	679,478.61	1,421,513.66
债券利息收入	112,228,003.31	176,379,695.03
资产支持证券利息收入	-	-

买入返售金融资产收入	99,113.64	666,983.75
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	-188,498,551.23	28,618,938.75
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-7,449,454.23	-
债券投资收益	-192,075,455.04	51,487,881.06
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	10,245,202.28	-23,323,940.86
股利收益	781,155.76	454,998.55
3. 公允价值变动收益	72,048,005.83	-177,142,180.63
4. 汇兑收益	24,807,723.26	-19,248,790.57
5. 其他收入	330,295.71	779,429.20
减：二、费用	30,171,341.83	48,180,099.62
1. 管理人报酬	19,424,210.24	32,262,882.35
2. 托管费	5,341,657.83	8,872,292.77
3. 销售服务费	3,212,986.05	4,693,192.91
4. 交易费用	1,328,802.54	1,920,532.06
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	472,814.39	-
7. 其他费用	390,870.78	431,199.53
三、利润总额	-8,477,272.70	-36,704,510.43
减：所得税费用	-	-
四、净利润	-8,477,272.70	-36,704,510.43

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方亚洲美元收益债券型证券投资基金

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）	3,110,262,751.10	277,875,710.70	3,388,138,461.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-8,477,272.70	-8,477,272.70

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）	-1,513,298,936.82	-109,538,092.12	-1,622,837,028.94
其中：1. 基金申购款	440,257,801.08	39,349,648.86	479,607,449.94
2. 基金赎回款	-1,953,556,737.90	-148,887,740.98	-2,102,444,478.88
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）	1,596,963,814.28	159,860,345.88	1,756,824,160.16
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）	3,902,777,466.14	397,498,849.60	4,300,276,315.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-36,704,510.43	-36,704,510.43
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）	-792,514,715.04	-82,918,628.47	-875,433,343.51
其中：1. 基金申购款	2,436,034,492.36	262,800,808.33	2,698,835,300.69
2. 基金赎回款	-3,228,549,207.40	-345,719,436.80	-3,574,268,644.20
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	3,110,262,751.10	277,875,710.70	3,388,138,461.80

权益（基金净值）			
----------	--	--	--

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：

<u>杨小松</u>	<u>徐超</u>	<u>徐超</u>
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[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) 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。

(4) 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
美国北美信托银行有限公司（“北美信托银行”）	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（“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

注：无。

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	19,424,210.24	32,262,882.35
其中：支付销售机构的客户维护费	7,688,405.05	11,043,975.22

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 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托管费	5,341,657.83	8,872,292.77

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 0.22% 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 × 0.22% / 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		
	C类人民币	C类美元现汇	合计

南方基金	27,571.54	-	27,571.54
中国工商银行	48,550.27	205,652.60	254,202.87
华泰证券	6,261.07	-	6,261.07
兴业证券	52.54	-	52.54
合计	82,435.42	205,652.60	288,088.02
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		
	南方亚洲美元债 A	南方亚洲美元债 C	合计
南方基金	106,004.04	-	106,004.04
中国工商银行	406,391.35	28,463.79	434,855.14
华泰证券	49,531.09	-	49,531.09
兴业证券	895.65	-	895.65
合计	562,822.13	28,463.79	591,285.92

注：支付销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50% 的年费率计提，每日计提，按月支付。由本基金的基金管理人南方基金向本基金的基金托管人中国工商银行发送划付指令，经中国工商银行复核后从基金财产中一次性支付给各销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.50% / 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

注：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固有资金投资本基金的情况

注：无。

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

南方亚洲美元债 A

关联方名称	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)

兴业证券	50,017,472.22	11.19%	50,017,472.22	4.87%
------	---------------	--------	---------------	-------

注:报告期末基金份额占比为持有该类别基金份额数占该类别基金份额总额的比例。兴业证券投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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	42,667,771.08	352,246.55	182,101,321.18	860,295.68
北美信托银行	91,594,261.66	320,790.69	110,941,083.94	549,213.30

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人北美信托银行保管的银行存款,按适用约定利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.5 利润分配情况

注:无。

7.4.6 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券流通受限证券。

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注:本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

§ 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	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	22,648,560.00	1.27
3	固定收益投资	1,550,350,941.18	87.24
	其中：债券	1,550,350,941.18	87.24
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	587,591.36	-
	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	134,262,032.74	7.56
8	其他各项资产	69,789,447.16	3.93
9	合计	1,777,050,981.08	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.4 期末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：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

注:本基金本报告期末未持有股票。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位: 人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
AAA 至 AA-	10,434,191.59	0.59
A+ 至 A-	177,220,040.50	10.09
BBB+ 至 BBB-	390,964,130.42	22.25
BB+ 至 BB-	646,331,329.29	36.79
B+ 至 B-	185,692,976.61	10.57
其他	139,708,272.77	7.95
合计	1,550,350,941.18	88.25

注:本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息,未提供评级信息的可适用内部评级。

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

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	XS1326527246	BNKEA 5 1/2 12/29/49	246,950	166,007,161.56	9.45
2	XS1165659514	HRAM 5 1/2 01/16/25	240,000	164,860,103.62	9.38
3	XS1122780106	SRIRJK 8 1/4 06/07/21	148,000	112,418,653.05	6.40
4	USY2749KAB62	BCHINA 6 3/4 10/31/49 CORP	990,000	103,739,930.92	5.90
5	USY7150MAB38	PTTEPT 4/7/8 PERP CORP	139,610	95,512,436.71	5.44

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

金额单位: 人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	期货	USD/CNH FXFuturesMar	587,591.36	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	VanEck Vectors J.P. Morgan EM Local Currency Bond ETF	ETF	交易型开 发式	Van Eck Associates Corp	22,648,560.00	1.29

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	31,789,088.91
2	应收证券清算款	18,813,381.40
3	应收股利	205,840.20
4	应收利息	18,867,346.48
5	应收申购款	113,790.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	69,789,447.16

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

注：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

份额级别	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 (%)
南方亚洲美元债 A	15,667	74,669.75	63,771,056.45	5.45	1,106,079,869.82	94.55
南方亚洲美元债 C	24,178	17,665.35	511,568.55	0.12	426,601,319.46	99.88
合计	39,845	40,079.40	64,282,625.00	4.03	1,532,681,189.28	95.97

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	南方亚洲美元债 A	3,045,463.15	0.2603
	南方亚洲美元债 C	593,130.44	0.1389
	合计	3,638,593.59	0.2278

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的情况

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	南方亚洲美元债 A	0
	南方亚洲美元债 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方亚洲美元债 A	>100
	南方亚洲美元债 C	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方亚洲美元债 A	南方亚洲美元债 C
基金合同生效日 (2016 年 3 月 3 日) 基金份额总额	959,440,960.16	98,092,573.03
本报告期期初基金份额总额	2,264,654,590.94	845,608,160.16
本报告期基金总申购份额	297,632,786.45	142,625,014.63
减：本报告期基金总赎回份额	1,392,436,451.12	561,120,286.78
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	1,169,850,926.27	427,112,888.01

§ 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 130,000.00 元。该审计机构第 3 年为该基金提供审计服务。

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	
银河证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
BANK OF CHINA HONG KONG BRANCH	-	-	-	-	-	-
Barclays Bank	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas Corporate & Investment Banking	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-

CITI Group Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-
Credit Agricole	-	-	-	-	-	-
Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Co.,Ltd	-	-	-	-	-	-
ICBC International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific)Limited	-	-	-	-	-	-
KGI Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch (Asia Pacific) Ltd	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Ltd	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Nomura (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
SC Lowy	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered Bank (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-

The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
星展唯高达香港	-	-	-	-	-	-

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		基金交易	
	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	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	1,690,000,000.00	100.00%	-	-

BANK OF CHINA HONG KONG BRANCH	43,602,192.63	0.77%	-	-	-	-
Barclays Bank	1,108,431,514.54	19.49%	-	-	-	-
BNP Paribas Corporate & Investment Banking	226,745,358.05	3.99%	-	-	-	-
BOCI Securities Limited	128,542,377.14	2.26%	-	-	-	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	13,691,961.12	0.24%	-	-	160,367.01	100.00%
CITI Group Global Markets Asia Limited	298,268,928.38	5.24%	-	-	-	-
CITIC Securities International Company Limited	313,297,365.48	5.51%	-	-	-	-
Credit Agricole	116,940,473.77	2.06%	-	-	-	-
Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	56,097,852.48	0.99%	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	1,230,431,182.32	21.63%	-	-	-	-
Guotai Junan (Hong Kong) Limited	42,231,530.02	0.74%	-	-	-	-
Haitong International Securities Co.,Ltd	87,959,848.76	1.55%	-	-	-	-
ICBC International Securities Limited	69,315,787.46	1.22%	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific)Limited	105,642,242.59	1.86%	-	-	-	-
KGI Asia Limited	31,917,218.70	0.56%	-	-	-	-

Merrill Lynch (Asia Pacific) Ltd	33,151,528.43	0.58%	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Ltd	263,594,114.64	4.63%	-	-	-	-
Morgan Stanley Asia Limited	223,508,413.65	3.93%	-	-	-	-
Nomura (Hong Kong) Limited	133,539,496.35	2.35%	-	-	-	-
SC Lowy	109,398,166.60	1.92%	-	-	-	-
Standard Chartered Bank (Hong Kong) Ltd	117,442,902.59	2.06%	-	-	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	509,465,487.53	8.96%	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	330,070,965.91	5.80%	-	-	-	-
星展唯高达香港	94,602,182.68	1.66%	-	-	-	-

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。

§ 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。