

南方安睿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：招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。

基金托管人招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 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------|
| 基金简称 | 南方安睿混合 |
| 基金主代码 | 004648 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 7 月 13 日 |
| 基金管理人 | 南方基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 95,151,185.14 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“南方安睿”。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值，实际投资过程中，将“优化的 CPPI 策略”作为大类资产配置的主要出发点，主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×15%+上证国债指数收益率×85% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券投资为主的混合型基金，属于中低风险、中低收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 |

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 | 招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 | 95555 |
| 传真 | 0755-82763889 | 0755-83195201 |

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 |

| | |
|--|--|
| | |
|--|--|

§ 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 07 月 13 日（基金合同生效日） -2017 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------|--|
| 本期已实现收益 | 4,020,133.61 | 4,457,114.09 |
| 本期利润 | 391,666.41 | 3,441,438.20 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0027 | 0.0130 |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.90% | 1.24% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018 年末 | 2017 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0033 | 0.0124 |
| 期末基金资产净值 | 95,460,893.17 | 226,917,704.79 |
| 期末基金份额净值 | 1.0033 | 1.0124 |

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 | -1.58% | 0.30% | -0.39% | 0.24% | -1.19% | 0.06% |
| 过去六个月 | -1.83% | 0.28% | 0.13% | 0.22% | -1.96% | 0.06% |
| 过去一年 | -0.90% | 0.24% | 0.56% | 0.20% | -1.46% | 0.04% |
| 自基金合同 | 0.33% | 0.20% | 2.31% | 0.18% | -1.98% | 0.02% |

| | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|

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

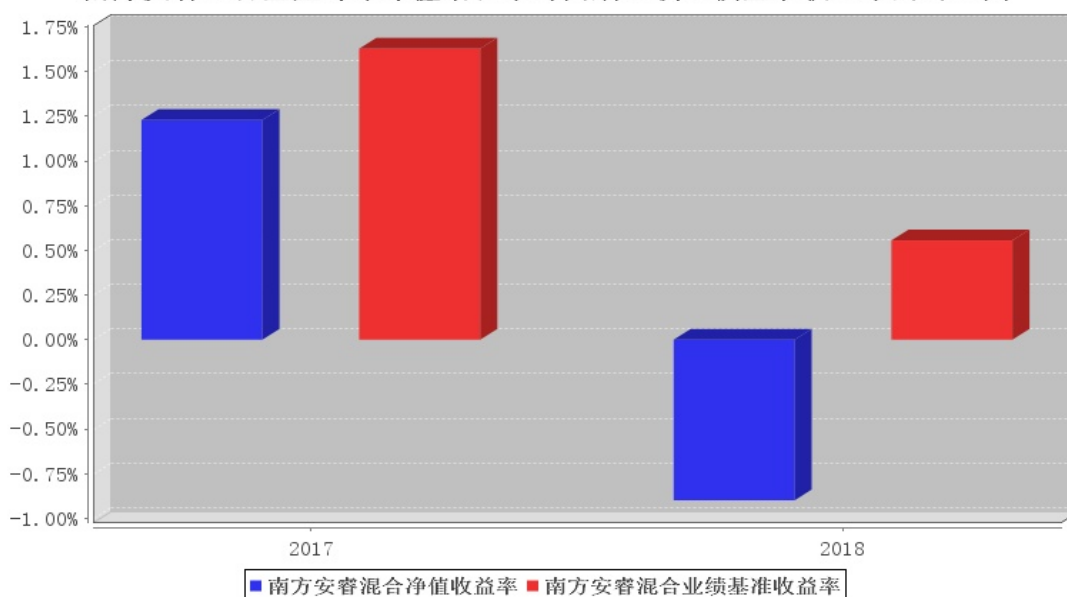
南方安睿混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金的基金合同生效日为 2017 年 7 月 13 日,本基金建仓期为 6 个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

南方安睿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



注:基金合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

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 | | |
| 孙鲁闽 | 本基金基金经理 | 2017年7月13日 | - | 15 | 南开大学理学和经济学双学士、澳大利亚新南威尔士大学商学硕士,具有基金从业资格。曾任职于厦门国际银行福州分行,2003年4月加入南方基金,历任行业研究员、南方高增和南方隆元的基金经理助理、专户投资管理部总监助理、权益投资部副总监,现任权益投资部董事总经理;2007年12月至2010年10月,担任南方基金企业年金和专户的投资经理。2011年6月至2017年7月,任南方保本 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | <p>基金经理；2015 年 12 月至 2017 年 12 月，任南方瑞利保本基金基金经理；2015 年 5 月至 2018 年 6 月，任南方丰合保本基金基金经理；2010 年 12 月至今，任南方避险基金经理；2015 年 4 月至今，任南方利淘基金经理；2015 年 5 月至今，任南方利鑫基金经理；2016 年 1 月至今，任南方益和保本基金基金经理；2016 年 9 月至今，任南方安泰混合基金经理；2016 年 11 月至今，任南方安裕混合基金经理；2017 年 7 月至今，任南方安睿混合基金经理；2017 年 12 月至今，任南方瑞利混合基金经理；2018 年 1 月至今，任南方融尚再融资基金经理；2018 年 6 月至今，任南方新蓝筹混合、南方改革机遇、南方甄智混合基金经理；2018 年 11 月至今，任南方固胜定期开放混合基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|---|

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

回顾2018年，伴随着美国加息、中美贸易战等外部不确定因素，以及中国经济增速逐步放缓、违约事件、流动性阶段性紧张等内部不确定因素，市场风险偏好受到压制。2018年股票市场震荡向下，沪深300下跌25%，创业板指下跌29%。债券市场走强，一年期AAA信用债到期收益率下降150bp，一年期国债到期收益率下降110bp。在风格上本基金的核心股票仓位投向低估值、高分红、具有安全边际的价值股，同时积极寻找具有竞争优势的白马股投资机会。固定收益投资上，本基金以短久期、高流动性、高评级的债券或存单适当加杠杆进行配置来获取稳定的持有收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0033 元，本报告期份额净值增长率为-0.90%，同期业绩比较基准增长率为 0.56%

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，国内地产周期回落和中美贸易战的负面影响逐步显现，资产价格波动和预期的不确定性也将影响居民的消费支出，未来经济下行压力较大。考虑到盈利周期滞后经济周期 2-4 个季度，未来上市公司整体盈利增速下滑可能超预期。从政策周期、估值周期、经济周期和盈利周期四要素来看，政策春天已全面到来。在市场最关心的公平和效率问题，最高领导、央行、各部委和交易所密集出台了各项政策或表态。在货币政策和财政政策放松后，估值周期的底在政策面和资金面的推动下正逐步到来。风格上，考虑到未来 A 股的增量资金仍将是外资、社保、养老金和银行理财等长线资金为主，我们认为资本市场的国际化和机构化导致盈利驱动个股的行情仍将是主流。

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，若本基金份额净值连续 10 个工作日不低于 1.15 元，且第 10 个工作日的基金可供分配利润大于零时，则本基金将以该日为基金收益分配基准日进行收益分配，但本基金两次收益分配基准日间的间隔不得低于 30 个工作日，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 90%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利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；同一类别每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机构另有规定的，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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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 23122 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：南方安睿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 | 附注号 | 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 | 7.4.7.1 | 2,256,245.79 | 27,379,555.00 |
| 结算备付金 | | 375,629.55 | 811,704.41 |
| 存出保证金 | | 6,961.62 | 17,559.33 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 94,019,718.51 | 213,937,384.91 |
| 其中：股票投资 | | 16,728,964.37 | 22,512,224.56 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 77,290,754.14 | 191,425,160.35 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 242,289.21 | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 1,592,231.62 | 3,851,748.23 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 98.81 | 197.63 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 98,493,175.11 | 245,998,149.51 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2018 年 12 月 31 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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 2,500,000.00 | 18,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | - | 93,877.93 |
| 应付赎回款 | | 62,839.75 | 530,812.65 |
| 应付管理人报酬 | | 83,763.34 | 196,201.03 |
| 应付托管费 | | 16,752.68 | 39,240.23 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 6,419.85 | 23,541.04 |
| 应交税费 | | 6,023.42 | - |
| 应付利息 | | 2,482.90 | 22,771.84 |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|----------------|
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 354,000.00 | 174,000.00 |
| 负债合计 | | 3,032,281.94 | 19,080,444.72 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 95,151,185.14 | 224,129,722.92 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 309,708.03 | 2,787,981.87 |
| 所有者权益合计 | | 95,460,893.17 | 226,917,704.79 |
| 负债和所有者权益总计 | | 98,493,175.11 | 245,998,149.51 |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0033 元，基金份额总额 95,151,185.14 份。

7.2 利润表

会计主体：南方安睿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 | 附注号 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2017 年 7 月 13 日（基 金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|----------|---|--|
| 一、收入 | | 3,332,790.30 | 5,454,927.44 |
| 1. 利息收入 | | 5,478,249.67 | 4,709,246.95 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 702,454.34 | 537,790.11 |
| 债券利息收入 | | 4,746,311.12 | 3,253,652.56 |
| 资产支持证券利息 收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产 收入 | | 29,484.21 | 917,804.28 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-” 填列） | | 753,462.05 | 1,100,300.12 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | -278,524.23 | 1,095,088.40 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 324,908.04 | -39,270.58 |
| 资产支持证券投资 收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | 707,078.24 | 44,482.30 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以 “-”号填列） | 7.4.7.17 | -3,628,467.20 | -1,015,675.89 |

| | | | |
|---------------------|------------|--------------|--------------|
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列) | 7.4.7.18 | 729,545.78 | 661,056.26 |
| 减：二、费用 | | 2,941,123.89 | 2,013,489.24 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 1,511,708.75 | 1,251,577.83 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 302,341.69 | 250,315.63 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 93,610.27 | 94,305.63 |
| 5. 利息支出 | | 623,105.31 | 235,485.55 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 623,105.31 | 235,485.55 |
| 6. 税金及附加 | | 10,020.41 | - |
| 7. 其他费用 | 7.4.7.20 | 400,337.46 | 181,804.60 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 391,666.41 | 3,441,438.20 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 391,666.41 | 3,441,438.20 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：南方安睿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) | 224,129,722.92 | 2,787,981.87 | 226,917,704.79 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 391,666.41 | 391,666.41 |
| 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) | -128,978,537.78 | -2,869,940.25 | -131,848,478.03 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,810,955.91 | 45,785.56 | 1,856,741.47 |

| | | | |
|--|--|---------------|-----------------|
| 2. 基金赎回款 | -130,789,493.69 | -2,915,725.81 | -133,705,219.50 |
| 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） | 95,151,185.14 | 309,708.03 | 95,460,893.17 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017年7月13日（基金合同生效日）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） | 287,436,926.79 | - | 287,436,926.79 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 3,441,438.20 | 3,441,438.20 |
| 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） | -63,307,203.87 | -653,456.33 | -63,960,660.20 |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,121,714.77 | 20,455.81 | 2,142,170.58 |
| 2. 基金赎回款 | -65,428,918.64 | -673,912.14 | -66,102,830.78 |
| 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） | 224,129,722.92 | 2,787,981.87 | 226,917,704.79 |

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

南方安睿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[2016]3091号《关于准予南方安睿混合型证券投资基金注册的批复》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《南方安睿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287,314,331.40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(2017)第661号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方安睿混合型证券投资基金基金合同》于2017年7月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为287,436,926.79份基金份额,其中认购资金利息折合122,595.39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,基金托管人为招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《南方安睿混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、权证、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等及法律法规或中国证监会允许基金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0-30%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 \times 15%+上证国债指数收益率 \times 85%。

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》、《南方安睿混合型证券

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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[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 重要财务报表项目的说明

7.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018 年 12 月 31 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 2,256,245.79 | 2,379,555.00 |
| 定期存款 | - | 25,000,000.00 |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - | 25,000,000.00 |
| 其他存款 | - | - |
| 合计 | 2,256,245.79 | 27,379,555.00 |

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018 年 12 月 31 日 | | |
|---------------|-------------------------|---------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 21,749,075.86 | 16,728,964.37 | -5,020,111.49 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债 交易所市场 | 76,914,785.74 | 77,290,754.14 | 375,968.40 |

| | | | | |
|---------------|---------------------|----------------|----------------|---------------|
| 券 | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | 76,914,785.74 | 77,290,754.14 | 375,968.40 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 98,663,861.60 | 94,019,718.51 | -4,644,143.09 |
| 项目 | 上年度末 2017年12月31日 | | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | | 21,735,303.52 | 22,512,224.56 | 776,921.04 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 86,245,239.06 | 84,706,160.35 | -1,539,078.71 |
| | 银行间市场 | 106,972,518.22 | 106,719,000.00 | -253,518.22 |
| | 合计 | 193,217,757.28 | 191,425,160.35 | -1,792,596.93 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 214,953,060.80 | 213,937,384.91 | -1,015,675.89 |

7.4.6.3 衍生金融资产/负债

注:无。

7.4.6.4 买入返售金融资产

注:无。

7.4.6.5 应收利息

单位:人民币元

| 项目 | 本期末 2018年12月31日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 426.39 | 456.93 |
| 应收定期存款利息 | - | 475,000.00 |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | 186.01 | 401.72 |
| 应收债券利息 | 1,591,615.81 | 3,375,880.89 |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | - | - |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 其他 | 3.41 | 8.69 |
| 合计 | 1,592,231.62 | 3,851,748.23 |

7.4.6.6 其他资产

注:无。

7.4.6.7 应付交易费用

单位:人民币元

| 项目 | 本期末 2018年12月31日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 6,244.85 | 23,541.04 |
| 银行间市场应付交易费用 | 175.00 | - |
| 合计 | 6,419.85 | 23,541.04 |

7.4.6.8 其他负债

单位:人民币元

| 项目 | 本期末 2018年12月31日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | - | - |
| 预提费用 | 354,000.00 | 174,000.00 |
| 合计 | 354,000.00 | 174,000.00 |

7.4.6.9 实收基金

金额单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | |
|---------------|-----------------------------|-----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 224,129,722.92 | 224,129,722.92 |
| 本期申购 | 1,810,955.91 | 1,810,955.91 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -130,789,493.69 | -130,789,493.69 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 95,151,185.14 | 95,151,185.14 |

注:申购含转换入份额;赎回含转换出份额。

7.4.6.10 未分配利润

单位:人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 3,782,037.23 | -994,055.36 | 2,787,981.87 |
| 本期利润 | 4,020,133.61 | -3,628,467.20 | 391,666.41 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,066,759.48 | 1,196,819.23 | -2,869,940.25 |

| | | | |
|----------|---------------|---------------|---------------|
| 其中：基金申购款 | 52,850.80 | -7,065.24 | 45,785.56 |
| 基金赎回款 | -4,119,610.28 | 1,203,884.47 | -2,915,725.81 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,735,411.36 | -3,425,703.33 | 309,708.03 |

7.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年12月 31日 | 上年度可比期间 2017年7月13日（基金合 同生效日）至2017年12月 31日 |
|-----------|---------------------------------|--|
| 活期存款利息收入 | 27,216.95 | 47,022.35 |
| 定期存款利息收入 | 665,625.00 | 475,000.00 |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 9,453.60 | 15,662.14 |
| 其他 | 158.79 | 105.62 |
| 合计 | 702,454.34 | 537,790.11 |

7.4.6.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年12月 31日 | 上年度可比期间 2017年7月13日（基金合 同生效日）至2017年12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--|
| 卖出股票成交总额 | 30,801,160.86 | 24,372,846.71 |
| 减：卖出股票成本 总额 | 31,079,685.09 | 23,277,758.31 |
| 买卖股票差价收入 | -278,524.23 | 1,095,088.40 |

7.4.6.13 债券投资收益

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7月13日（基金合 同生效日）至2017年12月31日 |
|---------------------------------|---------------------------------|--|
| 卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成交总 额 | 174,800,184.69 | 45,452,556.28 |
| 减：卖出债券（、债转 股及债券到期兑付）成 本总额 | 169,551,001.65 | 45,011,385.07 |
| 减：应收利息总额 | 4,924,275.00 | 480,441.79 |
| 买卖债券差价收入 | 324,908.04 | -39,270.58 |

7.4.6.14 贵金属投资收益

注:无。

7.4.6.15 衍生工具收益

注:无。

7.4.6.16 股利收益

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7月13日(基金合同生效 日)至2017年12月31日 |
|-------------|---------------------------------|--|
| 股票投资产生的股利收益 | 707,078.24 | 44,482.30 |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 707,078.24 | 44,482.30 |

7.4.6.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

| 项目名称 | 本期 2018年1月1日至2018年 12月31日 | 上年度可比期间 2017年7月13日(基金 合同生效日)至2017年12月 31日 |
|-----------------------------|---------------------------------|--|
| 1. 交易性金融资产 | -3,628,467.20 | -1,015,675.89 |
| 股票投资 | -5,797,032.53 | 776,921.04 |
| 债券投资 | 2,168,565.33 | -1,792,596.93 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 2. 衍生工具 | - | - |
| 权证投资 | - | - |
| 3. 其他 | - | - |
| 减: 应税金融商品公允价 值变动产生的预估增值税 | - | - |
| 合计 | -3,628,467.20 | -1,015,675.89 |

7.4.6.18 其他收入

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7月13日(基金合 同生效日)至2017年12月 31日 |
|---------|---------------------------------|--|
| 基金赎回费收入 | 702,480.97 | 648,014.03 |
| 基金转换费收入 | 27,064.81 | 13,021.42 |

| | | |
|----|------------|------------|
| 其他 | - | 20.81 |
| 合计 | 729,545.78 | 661,056.26 |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，，不低于赎回费全额归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.6.19 交易费用

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 7 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日 |
| 交易所市场交易费用 | 92,635.27 | 93,480.63 |
| 银行间市场交易费用 | 975.00 | 825.00 |
| 合计 | 93,610.27 | 94,305.63 |

7.4.6.20 其他费用

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 7 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日 |
| 审计费用 | 54,000.00 | 54,000.00 |
| 信息披露费 | 300,000.00 | 120,000.00 |
| 账户维护费 | 36,900.00 | 3,000.00 |
| 银行费用 | 9,137.46 | 4,304.60 |
| 其他 | 300.00 | 500.00 |
| 合计 | 400,337.46 | 181,804.60 |

7.4.6.21 分部报告

无。

7.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.7.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.8 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 |

| | |
|--------------------|-----------------|
| 招商银行股份有限公司(“招商银行”) | 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。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 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7月13日(基金合同生效日) 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 | 6,577,194.92 | 10.64 | 30,077,982.65 | 43.54 |

7.4.9.1.2 权证交易

注:无。

7.4.9.1.3 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 | 5,924.08 | 10.56 | 2,997.54 | 48.00 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2017年7月13日(基金合同生效日)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 | 27,310.16 | 43.52 | 8,769.95 | 37.25 |
|------|-----------|-------|----------|-------|

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。

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 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7月13日（基金合 同生效日）至2017年 12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,511,708.75 | 1,251,577.83 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 721,452.76 | 628,771.31 |

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 1.00% 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 1.00% / 当年天数。

7.4.9.2.2 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7月13日（基金合 同生效日）至2017年 12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 302,341.69 | 250,315.63 |

注：支付基金托管人招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 X 0.20% / 当年天数。

7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

注：无。

7.4.9.5 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7月13日（基金合同生效日）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 |
| 招商银行股份有限公司 | 2,256,245.79 | 27,216.95 | 2,379,555.00 | 47,022.35 |

注：本基金由基金托管人招商银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.10 利润分配情况

注：无。

7.4.11 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.11.1 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：债券 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|------------|--------|--------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 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：张） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 110049 | 海尔转债 | 2018-12-19 | 2019-01-18 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 150 | 15,000.00 | 15,000.00 | - |

7.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

7.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出

回购证券款余额 2,500,000.00 元，截至 2019 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§ 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 | 16,728,964.37 | 16.98 |
| | 其中：股票 | 16,728,964.37 | 16.98 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 77,290,754.14 | 78.47 |
| | 其中：债券 | 77,290,754.14 | 78.47 |
| | 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 | 2,631,875.34 | 2.67 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,841,581.26 | 1.87 |
| 9 | 合计 | 98,493,175.11 | 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 | 7,416,516.12 | 7.77 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 156,060.00 | 0.16 |
| E | 建筑业 | 602,928.00 | 0.63 |
| F | 批发和零售业 | 1,601,061.25 | 1.68 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 862,105.00 | 0.90 |
| 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 | 5,828,294.00 | 6.11 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 262,000.00 | 0.27 |
| 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 | 16,728,964.37 | 17.52 |

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：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 | 601166 | 兴业银行 | 220,100 | 3,288,294.00 | 3.44 |
| 2 | 601009 | 南京银行 | 250,000 | 1,615,000.00 | 1.69 |
| 3 | 601818 | 光大银行 | 250,000 | 925,000.00 | 0.97 |
| 4 | 000786 | 北新建材 | 65,800 | 905,408.00 | 0.95 |
| 5 | 601966 | 玲珑轮胎 | 50,000 | 682,500.00 | 0.71 |
| 6 | 600887 | 伊利股份 | 27,000 | 617,760.00 | 0.65 |
| 7 | 600068 | 葛洲坝 | 95,400 | 602,928.00 | 0.63 |
| 8 | 600056 | 中国医药 | 43,200 | 543,024.00 | 0.57 |
| 9 | 600176 | 中国巨石 | 55,060 | 532,430.20 | 0.56 |
| 10 | 600519 | 贵州茅台 | 900 | 531,009.00 | 0.56 |

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 | 601166 | 兴业银行 | 2,038,308.00 | 0.90 |
| 2 | 601229 | 上海银行 | 1,504,307.00 | 0.66 |
| 3 | 601818 | 光大银行 | 1,059,500.00 | 0.47 |
| 4 | 600056 | 中国医药 | 929,253.00 | 0.41 |
| 5 | 601966 | 玲珑轮胎 | 896,063.00 | 0.39 |
| 6 | 600887 | 伊利股份 | 775,414.00 | 0.34 |
| 7 | 000786 | 北新建材 | 736,394.00 | 0.32 |
| 8 | 600690 | 青岛海尔 | 725,342.00 | 0.32 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 9 | 002027 | 分众传媒 | 660,664.65 | 0.29 |
| 10 | 002462 | 嘉事堂 | 655,641.00 | 0.29 |
| 11 | 000910 | 大亚圣象 | 643,642.00 | 0.28 |
| 12 | 600519 | 贵州茅台 | 614,901.00 | 0.27 |
| 13 | 600741 | 华域汽车 | 597,193.00 | 0.26 |
| 14 | 600030 | 中信证券 | 594,030.00 | 0.26 |
| 15 | 601009 | 南京银行 | 577,086.00 | 0.25 |
| 16 | 002396 | 星网锐捷 | 498,814.00 | 0.22 |
| 17 | 300463 | 迈克生物 | 490,650.00 | 0.22 |
| 18 | 000895 | 双汇发展 | 483,170.00 | 0.21 |
| 19 | 300628 | 亿联网络 | 472,836.00 | 0.21 |
| 20 | 002597 | 金禾实业 | 441,346.00 | 0.19 |

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 | 601229 | 上海银行 | 1,556,518.80 | 0.69 |
| 2 | 002511 | 中顺洁柔 | 1,255,955.68 | 0.55 |
| 3 | 000651 | 格力电器 | 1,097,395.95 | 0.48 |
| 4 | 002304 | 洋河股份 | 869,118.00 | 0.38 |
| 5 | 601009 | 南京银行 | 807,061.00 | 0.36 |
| 6 | 603368 | 柳药股份 | 665,911.80 | 0.29 |
| 7 | 002242 | 九阳股份 | 573,835.00 | 0.25 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 561,686.00 | 0.25 |
| 9 | 600270 | 外运发展 | 515,650.02 | 0.23 |
| 10 | 601169 | 北京银行 | 504,434.00 | 0.22 |
| 11 | 300628 | 亿联网络 | 475,652.00 | 0.21 |
| 12 | 002396 | 星网锐捷 | 461,567.95 | 0.20 |
| 13 | 300571 | 平治信息 | 456,101.50 | 0.20 |
| 14 | 002152 | 广电运通 | 434,148.00 | 0.19 |
| 15 | 300463 | 迈克生物 | 424,434.00 | 0.19 |
| 16 | 000910 | 大亚圣象 | 423,687.00 | 0.19 |
| 17 | 000895 | 双汇发展 | 418,330.00 | 0.18 |
| 18 | 603056 | 德邦股份 | 406,417.00 | 0.18 |
| 19 | 000423 | 东阿阿胶 | 396,224.00 | 0.17 |
| 20 | 002146 | 荣盛发展 | 361,844.00 | 0.16 |

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 | 31,093,457.43 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 30,801,160.86 |

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 | 7,030,800.00 | 7.37 |
| | 其中：政策性金融债 | 7,030,800.00 | 7.37 |
| 4 | 企业债券 | 69,799,164.10 | 73.12 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 460,790.04 | 0.48 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 77,290,754.14 | 80.97 |

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 | 136270 | 16 南网 01 | 79,990 | 7,886,214.10 | 8.26 |
| 2 | 127121 | 15 苏国信 | 70,000 | 7,084,700.00 | 7.42 |
| 3 | 122352 | 12 广汽 03 | 70,000 | 7,062,300.00 | 7.40 |
| 4 | 018005 | 国开 1701 | 70,000 | 7,030,800.00 | 7.37 |
| 5 | 136469 | 16 联通 01 | 70,000 | 6,976,900.00 | 7.31 |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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：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

注: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

注: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

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

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 | 6,961.62 |
| 2 | 应收证券清算款 | 242,289.21 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,592,231.62 |
| 5 | 应收申购款 | 98.81 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,841,581.26 |

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 | 123009 | 星源转债 | 202,604.60 | 0.21 |
| 2 | 128015 | 久其转债 | 278.64 | 0.00 |

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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 (%) |
| 1,497 | 63,561.25 | 0.00 | 0.00 | 95,151,185.14 | 100.00 |

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 | 958,642.75 | 1.0075 |

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

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 (2017 年 7 月 13 日) 基金份额总额 | 287,436,926.79 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 224,129,722.92 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,810,955.91 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 130,789,493.69 |
| 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 | 95,151,185.14 |

§ 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 54,000 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 2 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 | |
| 广发证券 | 1 | 17,213,800.63 | 27.85% | 15,638.59 | 27.89% | - |
| 西藏东财 | 1 | 16,122,634.66 | 26.08% | 14,692.56 | 26.20% | - |
| 银河证券 | 1 | 13,752,414.39 | 22.25% | 12,529.60 | 22.34% | - |
| 方正证券 | 1 | 8,143,252.17 | 13.17% | 7,293.13 | 13.01% | - |

| | | | | | | |
|------|---|--------------|--------|----------|--------|---|
| 华泰证券 | 2 | 6,577,194.92 | 10.64% | 5,924.08 | 10.56% | - |
|------|---|--------------|--------|----------|--------|---|

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 |
| 方正证券 | 3,194,617.95 | 4.43% | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1,211,443.76 | 1.68% | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 42,341,859.32 | 58.66% | 80,200,000.00 | 7.22% | - | - |
| 西藏东财 | 21,661,238.80 | 30.01% | 415,800,000.00 | 37.43% | - | - |
| 银河证券 | 3,776,648.20 | 5.23% | 615,000,000.00 | 55.36% | - | - |

§ 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

注:无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。