

# 南方恒生交易型开放式指数证券投资 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

### 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         | 南方恒生 ETF         |
| 场内简称         | 恒指 ETF           |
| 基金主代码        | 513600           |
| 基金运作方式       | 交易型开放式 (ETF)     |
| 基金合同生效日      | 2014 年 12 月 23 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   | 28,829,500.00 份  |
| 基金合同存续期      | 不定期              |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所          |
| 上市日期         | 2015 年 1 月 26 日  |

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“恒指 ETF”。

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。  |
| 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标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的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。             |
| 业绩比较基准 | 本基金业绩比较基准为标的指数(使用估值汇率调整),本基金标的指数为恒生指数。   |
| 风险收益特征 | 本基金属股票指数基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资香港证券市场上市的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。 |

### 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<br>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 境外投资顾问和境外资产托管人

注:无。

## 2.5 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        | 2016 年        |
|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期已实现收益       | 2,067,837.52  | 4,551,851.86  | -4,630,775.68 |
| 本期利润          | -5,708,303.10 | 14,226,771.28 | 8,019,694.85  |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.2072       | 0.5781        | 0.1747        |
| 本期基金份额净值增长率   | -8.00%        | 28.81%        | 8.49%         |
| 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  | 0.2254        | 0.1522        | -0.0348       |
| 期末基金资产净值      | 69,194,653.47 | 75,213,611.47 | 54,339,600.12 |
| 期末基金份额净值      | 2.4001        | 2.6089        | 2.0254        |

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

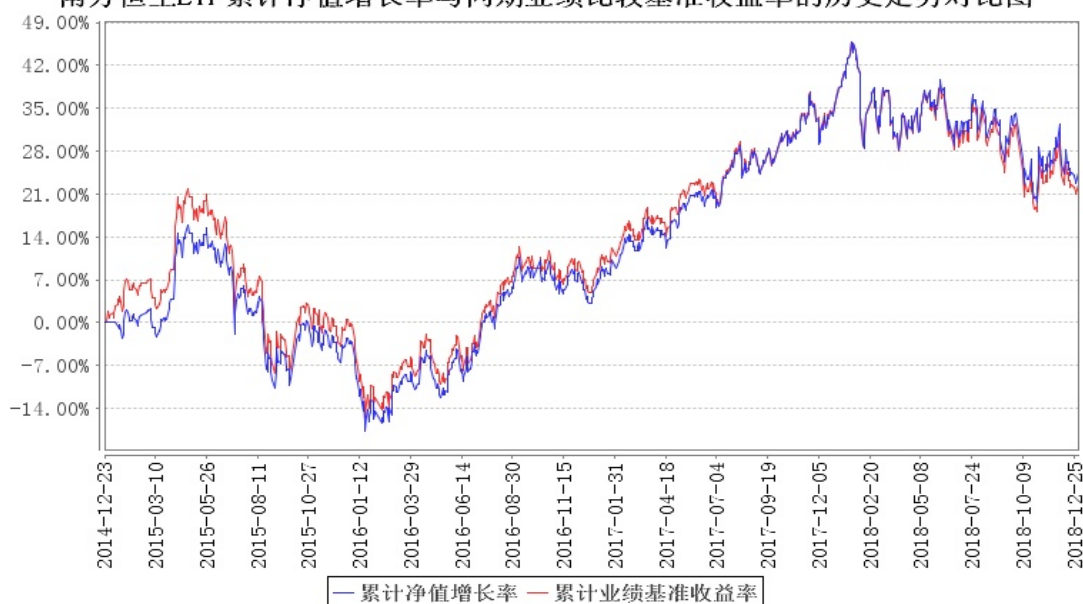
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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          | -7.16% | 1.54% | -7.39% | 1.56% | 0.23% | -0.02% |
| 过去六个月          | -6.34% | 1.29% | -7.23% | 1.30% | 0.89% | -0.01% |
| 过去一年           | -8.00% | 1.26% | -9.44% | 1.26% | 1.45% | -0.01% |
| 过去三年           | 28.55% | 1.07% | 23.35% | 1.08% | 5.20% | -0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 24.48% | 1.13% | 22.54% | 1.16% | 1.94% | -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

南方恒生ETF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

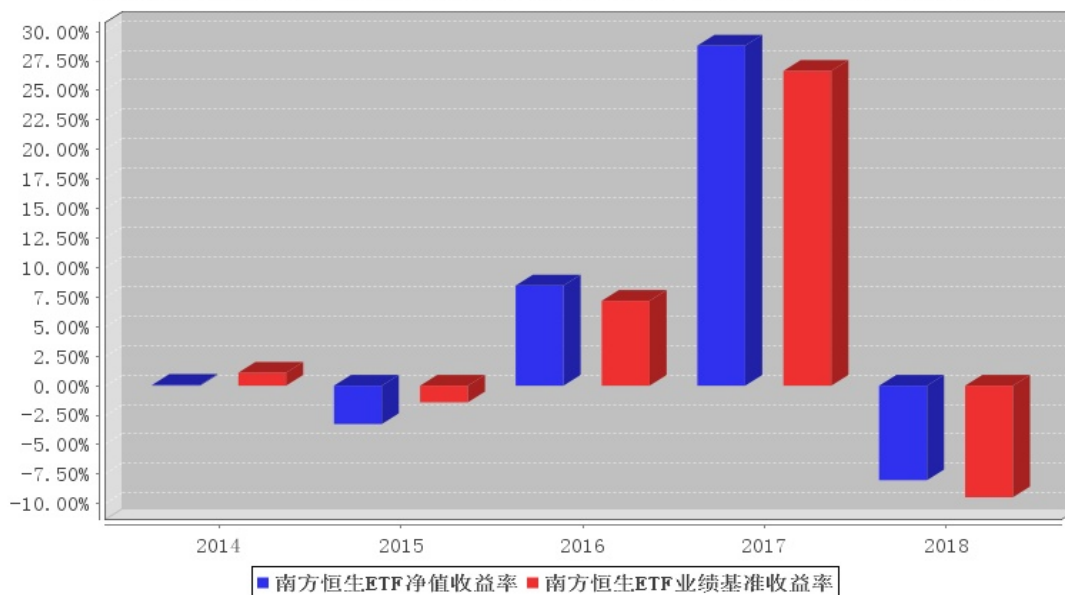


注:1. 基金合同中关于基金投资比例的约定: 本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。在建仓完成后, 本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。

2. 本基金的建仓期为三个月, 建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 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

南方恒生ETF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 |        |  |
| 罗文杰 | 本基金基金经理 | 2015年2月16日      | -    | 13     | 女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008年9月加入南方基金，任南方基金数量化投资部基金经理助理；2013年4月起担任数量化投资部基金经理；现任指数投资部总经理。2013年5月至2015年6月，任南方策略基金经理；2013年4月至今，任南方500、南方500ETF基金经理；2013年5月至今，任南方300、南方开元沪深300ETF基金经理；2014年10月至今，任500医药基金经理；2015年2月至今，任南方恒生ETF基金经理；2016年12月至今，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2017年7月至今，任恒生联接基金经理；2017年8月至今，任南方房地产联接、南方房地产ETF基金经理；2017年11月至今，任南方策略、南方量化混合基金经理；2018年2月至今，任H股ETF、南方H股ETF联接基金经理；2018年4月至今，任MSCI基金基金经理；2018年6月至今，任MSCI联接基金经理。 |

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注:无。

#### 4.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

##### 4.4.2 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。

##### 4.4.3 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。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，恒生指数跌13.61%。期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF现金流精算系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：（1）大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；（2）港股通的交易风控资金的安排，导致基金实际仓位和基准的偏离；（3）报告期内，我们根据指数每半年度成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详



细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

#### 4.5.2 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 2.4001 元，报告期内，份额净值增长率为-8.00%，同期业绩基准增长率为-9.44%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年全球经济基本面分化严重，美国经济一枝独秀，联储持续加息，美元强势导致新兴市场经济雪上加霜，中美贸易战更是给全球经济笼罩了一层阴霾。展望 2019 年，预计美联储的持续加息将对消费和投资均有较大抑制作用，对经济增长的负向作用将越来越明显。国内经济方面，“投资、消费、进出口”三驾马车均面临较大的下行压力。同时 A 股市场估值接近历史底部，凸显长期配置价值。本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

#### 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，当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收

益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采取现金分红的方式；同一类别内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。

#### 4.9 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恒生交易型开放式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，南方恒生交易型开放式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恒生交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、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。

### 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恒生交易型开放式指数证券投资基金 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 23139 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：南方恒生交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 1,660,989.49                    | 2,747,790.22                     |
| 结算备付金           |            | -                               | 2,293,650.44                     |
| 存出保证金           |            | -                               | 121,459.28                       |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 67,645,032.03                   | 74,296,774.71                    |
| 其中：股票投资         |            | 67,645,032.03                   | 74,296,774.71                    |
| 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          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                               | 2,226,988.77                     |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 544.03                          | 1,378.77                         |
| 应收股利            |            | 455.62                          | 13,834.07                        |
| 应收申购款           |            | -                               | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 69,307,021.17                   | 81,701,876.26                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>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          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | 14.64                           | 794.34                           |
| 应付赎回款           |            | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 28,416.01                       | 33,762.69                        |
| 应付托管费           |            | 5,683.23                        | 6,752.55                         |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 20,049.81                       | 1,276,801.92                     |
| 应交税费            |            | -                               | -                                |

|               |          |               |               |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 应付利息          |          | -             | -             |
| 应付利润          |          | -             | -             |
| 递延所得税负债       |          | -             | -             |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 58,204.01     | 5,170,153.29  |
| 负债合计          |          | 112,367.70    | 6,488,264.79  |
| <b>所有者权益：</b> |          |               |               |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 55,586,500.14 | 55,586,500.15 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 13,608,153.33 | 19,627,111.32 |
| 所有者权益合计       |          | 69,194,653.47 | 75,213,611.47 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 69,307,021.17 | 81,701,876.26 |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.4001 元，基金份额总额 28,829,500.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方恒生交易型开放式指数证券投资基金

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          | 附注号        | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-------------|------------|---|--|
| 一、收入        |            | -4,977,622.84                             | 14,980,184.55                                  |
| 1. 利息收入     |            | 16,591.72                                 | 25,713.40                                      |
| 其中：存款利息收入   | 7.4.7.11   | 16,591.72                                 | 25,713.40                                      |
| 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     |            | 2,617,009.17                              | 5,192,117.34                                   |
| 其中：股票投资收益   | 7.4.7.12   | 706,162.87                                | 3,561,346.00                                   |
| 基金投资收益      | 7.4.7.13   | -   | -  |
| 债券投资收益      | 7.4.7.14   | -   | -  |
| 资产支持证券投资收益  |            | -   | -  |
| 贵金属投资收益     | 7.4.7.15   | -   | -  |
| 衍生工具收益      | 7.4.7.16   | -   | -  |
| 股利收益        | 7.4.7.17   | 1,910,846.30                              | 1,630,771.34                                   |
| 3. 公允价值变动收益 | 7.4.7.18   | -7,776,140.62                             | 9,674,919.42                                   |
| 4. 汇兑收益     |            | -   | -  |
| 5. 其他收入     | 7.4.7.19   | 164,916.89                                | 87,434.39                                      |
| 减：二、费用      |            | 730,680.26                                | 753,413.27                                     |
| 1. 管理人报酬    | 7.4.10.2.1 | 352,550.17                                | 288,372.92                                     |
| 2. 托管费      | 7.4.10.2.2 | 70,510.12                                 | 57,674.60                                      |
| 3. 销售服务费    |            | -   | -  |
| 4. 交易费用     | 7.4.7.20   | 116,136.89                                | 206,555.12                                     |

|               |          |               |               |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 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       | 7.4.7.21 | 191,483.08    | 200,810.63    |
| 三、利润总额        |          | -5,708,303.10 | 14,226,771.28 |
| 减：所得税费用       |          | -             | -             |
| 四、净利润         |          | -5,708,303.10 | 14,226,771.28 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方恒生交易型开放式指数证券投资基金

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<br>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）                        | 55,586,500.15                    | 19,627,111.32 | 75,213,611.47  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -                                | -5,708,303.10 | -5,708,303.10  |
| 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）      | -0.01                            | -310,654.89   | -310,654.90    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 17,353,006.49                    | 5,605,619.55  | 22,958,626.04  |
| 2. 基金赎回款                               | -17,353,006.50                   | -5,916,274.44 | -23,269,280.94 |
| 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）                        | 55,586,500.14                    | 13,608,153.33 | 69,194,653.47  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 51,730,276.54  | 2,609,323.58  | 54,339,600.12  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -              | 14,226,771.28 | 14,226,771.28  |
| 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）      | 3,856,223.61   | 2,791,016.46  | 6,647,240.07   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 40,490,348.56  | 12,272,254.66 | 52,762,603.22  |
| 2. 基金赎回款                               | -36,634,124.95 | -9,481,238.20 | -46,115,363.15 |
| 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）                        | 55,586,500.15  | 19,627,111.32 | 75,213,611.47  |

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

南方恒生交易型开放式指数证券投资基金(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”)证监许可[2014]1297号《关于准予南方恒生交易型开放式指数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《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,

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 286,950,000.00 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(2014)第 830 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2014 年 12 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 286,959,921.00 份基金份额，其中通过直销机构网下现金认购部分的认购资金利息折合 9,921.00 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。

根据《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司确定 2015 年 1 月 15 日为本基金的基金份额折算日。当日恒生指数收盘值为 24,350.91 点，估值汇率为 0.78918，本基金的基金资产净值为人民币 286,012,480.64 元，折算前基金份额总额为 286,959,921.00 份。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.51864772，折算后基金份额总额为 148,829,500.00 份，折算后基金份额净值为 1.9217 元。本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司已根据上述折算比例，对所有基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2015 年 1 月 16 日完成了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2015]6 号审核同意，本基金于 2015 年 1 月 26 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数恒生指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；本基金投资于标的指数成份股、备选成份股(包括港股通股票中的标的指数成份股、备选成份股)、公募基金、依法发行上市的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、股指期货等金融衍生品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 80%。本基金力争将年化跟踪误差控制在 3%以内。本基金的业绩比较基准为恒生指数(使用估值汇率调整)。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF，于 2017 年 7 月 21 日募集成立了南方恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“南方恒生 ETF 联接基金”)。南方恒生 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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》、《南方恒生交易型开放式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[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[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]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。

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。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 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<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|----|-------------------------|--------------------------|
|----|-------------------------|--------------------------|

|                |              |              |
|----------------|--------------|--------------|
| 活期存款           | 1,660,989.49 | 2,747,790.22 |
| 定期存款           | -            | -            |
| 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    | -            | -            |
| 其他存款           | -            | -            |
| 合计             | 1,660,989.49 | 2,747,790.22 |

#### 7.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日  |               |               |
|---------------|--------------------------|---------------|---------------|
|               | 成本                       | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            | 70,408,289.41            | 67,645,032.03 | -2,763,257.38 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                        | -             | -             |
| 债券            | 交易所市场                    | -             | -             |
|               | 银行间市场                    | -             | -             |
|               | 合计                       | -             | -             |
| 资产支持证券        | -                        | -             | -             |
| 基金            | -                        | -             | -             |
| 其他            | -                        | -             | -             |
| 合计            | 70,408,289.41            | 67,645,032.03 | -2,763,257.38 |
| 项目            | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |               |               |
|               | 成本                       | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            | 69,283,891.47            | 74,296,774.71 | 5,012,883.24  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                        | -             | -             |
| 债券            | 交易所市场                    | -             | -             |
|               | 银行间市场                    | -             | -             |
|               | 合计                       | -             | -             |
| 资产支持证券        | -                        | -             | -             |
| 基金            | -                        | -             | -             |
| 其他            | -                        | -             | -             |
| 合计            | 69,283,891.47            | 74,296,774.71 | 5,012,883.24  |

注：于 2018 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为零(2017 年 12 月 31 日：同)。

#### 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<br>2018年12月31日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 316.23             | 730.08              |
| 应收定期存款利息   | -                  | -                   |
| 应收其他存款利息   | -                  | -                   |
| 应收结算备付金利息  | 227.80             | 648.69              |
| 应收债券利息     | -                  | -                   |
| 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         | -                  | -                   |
| 合计         | 544.03             | 1,378.77            |

## 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<br>2018年12月31日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 20,049.81          | 1,276,801.92        |
| 银行间市场应付交易费用 | -                  | -                   |
| 合计          | 20,049.81          | 1,276,801.92        |

## 7.4.6.8 其他负债

单位:人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年12月31日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | -                  | -                   |
| 应退替代款       | -                  | 5,097,083.42        |
| 预提费用        | 30,000.00          | 50,000.00           |
| 指数使用费       | -                  | -                   |
| 应付指数使用费     | 28,204.01          | 23,069.87           |
| 合计          | 58,204.01          | 5,170,153.29        |

注:应退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时,替代价格与实际买入成本或强制

退款成本之差乘以替代数量的金额。

#### 7.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 28,829,500.00               | 55,586,500.15  |
| 本期申购          | 9,000,000.00                | 17,353,006.49  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -9,000,000.00               | -17,353,006.50 |
| - 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           | 28,829,500.00               | 55,586,500.14  |

#### 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           | 4,388,458.17  | 15,238,653.15 | 19,627,111.32 |
| 本期利润           | 2,067,837.52  | -7,776,140.62 | -5,708,303.10 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 42,214.67     | -352,869.56   | -310,654.89   |
| 其中：基金申购款       | 1,760,835.36  | 3,844,784.19  | 5,605,619.55  |
| 基金赎回款          | -1,718,620.69 | -4,197,653.75 | -5,916,274.44 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 6,498,510.36  | 7,109,642.97  | 13,608,153.33 |

#### 7.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 13,448.41                   | 18,032.26                        |
| 定期存款利息收入  | -                           | -                                |
| 其他存款利息收入  | -                           | -                                |
| 结算备付金利息收入 | 2,986.66                    | 7,679.88                         |
| 其他        | 156.65                      | 1.26                             |
| 合计        | 16,591.72                   | 25,713.40                        |

#### 7.4.6.12 股票投资收益

##### 7.4.6.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2018年1月1日<br>至2018年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月<br>31日 |
|------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 706,162.87                          | 3,561,346.00                         |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                                   | -                                    |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                                   | -                                    |
| 合计               | 706,162.87                          | 3,561,346.00                         |

##### 7.4.6.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2018年1月1日至<br>2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年<br>12月31日 |
|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 28,390,625.42                   | 49,771,783.52                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 27,684,462.55                   | 46,210,437.52                        |
| 买卖股票差价收入   | 706,162.87                      | 3,561,346.00                         |

##### 7.4.6.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2018年1月1日至2018年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月<br>31日 |
|-------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 23,269,280.94                   | 46,115,363.15                        |
| 减：现金支付赎回款总额 | 23,269,280.94                   | 46,115,363.15                        |
| 减：赎回股票成本总额  | -                               | -                                    |
| 赎回差价收入      | -                               | -                                    |

#### 7.4.6.13 基金投资收益

注：无。

#### 7.4.6.14 债券投资收益

注：无。

**7.4.6.15 贵金属投资收益**

注:无。

**7.4.6.16 衍生工具收益**

注:无。

**7.4.6.17 股利收益**

单位:人民币元

| 项目          | 本期<br>2018年1月1日至<br>2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月<br>31日 |
|-------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,910,846.30                    | 1,630,771.34                         |
| 基金投资产生的股利收益 | -                               | -                                    |
| 合计          | 1,910,846.30                    | 1,630,771.34                         |

**7.4.6.18 公允价值变动收益**

单位:人民币元

| 项目名称                    | 本期<br>2018年1月1日至2018年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至<br>2017年12月31日 |
|-------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产              | -7,776,140.62                   | 9,674,919.42                         |
| 股票投资                    | -7,776,140.62                   | 9,674,919.42                         |
| 债券投资                    | -                               | -                                    |
| 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                      | -7,776,140.62                   | 9,674,919.42                         |

注:本基金本年度公允价值变动收益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动收益为零(2017年度:同)。

**7.4.6.19 其他收入**

单位:人民币元

| 项目      | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至<br>2017年12月31日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                               | -                                    |
| 替代损益    | 164,916.89                      | 87,423.51                            |

|    |            |           |
|----|------------|-----------|
| 其他 | -          | 10.88     |
| 合计 | 164,916.89 | 87,434.39 |

注:替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时,补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额,或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 7.4.6.20 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1月1日至2017年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 116,136.89            | 206,555.12            |
| 银行间市场交易费用 | -                     | -                     |
| 合计        | 116,136.89            | 206,555.12            |

#### 7.4.6.21 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1月1日至2017年12月31日 |
| 审计费用  | 30,000.00             | 50,000.00             |
| 信息披露费 | -                     | -                     |
| 银行汇划费 | -                     | -                     |
| 指数使用费 | 101,205.94            | 90,536.63             |
| 银行费用  | 277.14                | 274.00                |
| 上市费   | 60,000.00             | 60,000.00             |
| 其他    | -                     | -                     |
| 合计    | 191,483.08            | 200,810.63            |

注:指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费,按前一日基金资产净值的0.04%的年费率计提,逐日累计,按季支付标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)港币25,000元,计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。

#### 7.4.6.22 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            |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)                  | 基金托管人            |
| 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  |
| 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        |
| 南方恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“南方恒生 ETF 联接基金”) | 本基金的基金管理人管理的其他基金 |

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<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月<br>31 日 |                         | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |                         |
|-------|---|-------------------------|---|-------------------------|
|       | 成交金额                                      | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额  | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 华泰证券  | 57,134,698.61                             | 100.00                  | 107,152,948.39                              | 100.00                  |

##### 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<br>2018年1月1日至2018年12月31日      |                    |              |                      |
|-------|----------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 华泰证券  | 45,759.44                        | 100.00             | 20,049.81    | 100.00               |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |                    |              |                      |
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 华泰证券  | 85,722.62                        | 100.00             | 1,276,801.92 | 100.00               |

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<br>2018年1月1日至2018年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至<br>2017年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 352,550.17                      | 288,372.92                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                               | -                                    |

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 0.50% 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 0.50% / 当年天数。

#### 7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年1月1日至2018年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至<br>2017年12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 70,510.12                       | 57,674.60                            |

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 0.10% 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 0.10% / 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****7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

注:无。

**7.4.9.4.2 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**

| 关联方名称       | 本期末<br>2018年12月31日 |                                 | 上年度末<br>2017年12月31日 |                                 |
|-------------|--------------------|---------------------------------|---------------------|---------------------------------|
|             | 持有的<br>基金份额        | 持有的基金份额<br>占基金总份<br>额的比例<br>(%) | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金份额<br>占基金总份<br>额的比例<br>(%) |
| 南方恒生ETF联接基金 | 20,768,876.00      | 72.04                           | 18,919,176.00       | 65.62                           |

注:南方恒生 ETF 联接基金投资本基金相关的费用按基金合同和更新的招募说明书的有关规定以及与券商约定的席位佣金费率支付。

**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<br>2018年1月1日至2018年12月<br>31日 |           | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |           |
|--------------|---------------------------------|-----------|----------------------------------|-----------|
|              | 期末余额                            | 当期利息收入    | 期末余额                             | 当期利息收入    |
| 中国工商银行股份有限公司 | 1,660,989.49                    | 13,448.41 | 2,747,790.22                     | 18,032.26 |

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。

**7.4.9.6 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**

于2018年12月31日,本基金持有685,000.00股中国工商银行的H股普通股,成本总额为人民币3,467,940.03元,估值总额为人民币3,355,101.23元,占基金资产净值的比例为4.85%(于2017年12月31日,本基金持有701,000.00股中国工商银行的H股普通股,成本总额为人民币3,517,636.94元,估值总额为人民币3,685,769.60元,占基金资产净值的比例为4.90%)。

## 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

注:无。

## 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

注:无。

## § 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<br>(%) |
|----|-------------------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 67,645,032.03 | 97.60            |
|    | 其中:普通股            | 67,645,032.03 | 97.60            |
|    | 存托凭证              | -             | -                |
|    | 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      | 1,660,989.49  | 2.40             |
| 8  | 其他各项资产            | 999.65        | 0.00             |
| 9  | 合计                | 69,307,021.17 | 100.00           |

注:股票投资中通过沪港通买入港股公允价值合计为人民币 67,645,032.03 元,占基金净值比为

97.76%。

## 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（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 香港     | 67,645,032.03 | 97.76        |
| 合计     | 67,645,032.03 | 97.76        |

## 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     | 4,238,144.36  | 6.12         |
| 原材料    | -             | -            |
| 工业     | 337,731.29    | 0.49         |
| 非必需消费品 | 3,229,165.00  | 4.67         |
| 必需消费品  | 3,198,077.61  | 4.62         |
| 医疗保健   | 676,356.30    | 0.98         |
| 金融     | 40,739,561.07 | 58.88        |
| 科技     | 7,622,050.66  | 11.02        |
| 通讯     | 4,173,436.98  | 6.03         |
| 公用事业   | 3,430,508.76  | 4.96         |
| 政府     | -             | -            |
| 合计     | 67,645,032.03 | 97.76        |

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

### 8.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

注：本报告期末没有积极投资。

## 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

### 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  | HSBC Holdings Plc    | 汇丰控股有限公司 | 5 HK   | 香港联合交易所 | 香港       | 124,000 | 7,040,442.24 | 10.17        |
| 2  | Tencent Holdings Ltd | 腾讯控股有限公司 | 700 HK | 香港联合交易所 | 香港       | 25,300  | 6,960,708.04 | 10.06        |

|    |  |                  |         |         |    |           |              |      |
|----|--|------------------|---------|---------|----|-----------|--------------|------|
| 3  | AIA Group Limited                                | 友邦保险控股有限公司       | 1299 HK | 香港联合交易所 | 香港 | 112,000   | 6,378,736.00 | 9.22 |
| 4  | 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 | 1,005,000 | 5,688,553.26 | 8.22 |
| 5  | China Mobile Limited                             | 中国移动有限公司         | 941 HK  | 香港联合交易所 | 香港 | 57,000    | 3,763,235.19 | 5.44 |
| 6  | Industrial and Commercial Bank of China Limited  | 中国工商银行股份有限公司     | 1398 HK | 香港联合交易所 | 香港 | 685,000   | 3,355,101.23 | 4.85 |
| 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 | 52,000    | 3,150,639.96 | 4.55 |
| 8  | 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 | 738,000   | 2,185,628.33 | 3.16 |
| 9  | Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.            | 香港交易及结算所有限公司     | 388 HK  | 香港联合交易所 | 香港 | 11,000    | 2,184,016.12 | 3.16 |
| 10 | CNOOC Limited                                    | 中国海洋石油有限公司       | 883 HK  | 香港联合交易所 | 香港 | 167,000   | 1,770,537.34 | 2.56 |

注:基金对以上证券代码采用港股通交易代码。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。

#### 8.4.2 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  | Tencent Holdings Ltd                | 700 HK  | 3,651,859.07 | 4.86           |
| 2  | HSBC Holdings Plc                   | 5 HK    | 2,854,611.00 | 3.80           |
| 3  | China Construction Bank Corporation | 939 HK  | 2,463,252.67 | 3.28           |
| 4  | AIA Group Limited                   | 1299 HK | 2,096,320.72 | 2.79           |

|    |  |         |              |      |
|----|--|---------|--------------|------|
| 5  | China Mobile Limited                             | 941 HK  | 1,359,708.70 | 1.81 |
| 6  | Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd. | 2318 HK | 1,343,635.54 | 1.79 |
| 7  | Industrial and Commercial Bank of China Limited  | 1398 HK | 1,285,337.52 | 1.71 |
| 8  | CSPC Pharmaceutical Group Limited                | 1093 HK | 999,874.28   | 1.33 |
| 9  | Bank of China Limited                            | 3988 HK | 892,169.87   | 1.19 |
| 10 | Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.            | 388 HK  | 775,066.86   | 1.03 |
| 11 | CNOOC Limited                                    | 883 HK  | 749,142.72   | 1.00 |
| 12 | CK Hutchison Holdings Limited                    | 1 HK    | 723,030.40   | 0.96 |
| 13 | Shenzhou International Group Holdings Ltd.       | 2313 HK | 580,304.15   | 0.77 |
| 14 | China Petroleum & Chemical Corporation           | 386 HK  | 532,202.40   | 0.71 |
| 15 | Sino Biopharmaceutical Limited                   | 1177 HK | 530,228.76   | 0.70 |
| 16 | The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.             | 3 HK    | 470,442.60   | 0.63 |
| 17 | Galaxy Entertainment Group Limited               | 27 HK   | 464,041.20   | 0.62 |
| 18 | Cheung Kong Property Holdings Limited            | 1113 HK | 428,782.98   | 0.57 |
| 19 | CLP Holdings Ltd.                                | 2 HK    | 394,303.92   | 0.52 |
| 20 | China Life Insurance Company Limited             | 2628 HK | 384,114.84   | 0.51 |

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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。

### 8.5.2 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 Construction Bank Corporation | 939 HK  | 2,691,896.27 | 3.58           |
| 2  | Tencent Holdings Ltd                | 700 HK  | 2,613,640.52 | 3.47           |
| 3  | HSBC Holdings Plc                   | 5 HK    | 2,334,005.58 | 3.10           |
| 4  | AIA Group Limited                   | 1299 HK | 2,250,818.55 | 2.99           |

|    |  |         |              |      |
|----|--|---------|--------------|------|
| 5  | China Mobile Limited                             | 941 HK  | 1,362,522.88 | 1.81 |
| 6  | Industrial and Commercial Bank of China Limited  | 1398 HK | 1,357,915.26 | 1.81 |
| 7  | Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd. | 2318 HK | 1,173,386.84 | 1.56 |
| 8  | Bank of China Limited                            | 3988 HK | 955,246.04   | 1.27 |
| 9  | Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.            | 388 HK  | 805,122.84   | 1.07 |
| 10 | CK Hutchison Holdings Limited                    | 1 HK    | 761,670.89   | 1.01 |
| 11 | CNOOC Limited                                    | 883 HK  | 746,338.70   | 0.99 |
| 12 | China Petroleum & Chemical Corporation           | 386 HK  | 574,974.17   | 0.76 |
| 13 | The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.             | 3 HK    | 479,918.17   | 0.64 |
| 14 | Cheung Kong Property Holdings Limited            | 1113 HK | 451,046.45   | 0.60 |
| 15 | Galaxy Entertainment Group Limited               | 27 HK   | 438,162.80   | 0.58 |
| 16 | China Life Insurance Company Limited             | 2628 HK | 436,249.51   | 0.58 |
| 17 | The Bank of East Asia, Limited                   | 23 HK   | 420,579.85   | 0.56 |
| 18 | CLP Holdings Ltd.                                | 2 HK    | 419,918.13   | 0.56 |
| 19 | Sun Hung Kai Properties Ltd.                     | 16 HK   | 408,933.11   | 0.54 |
| 20 | Hang Seng Bank Ltd.                              | 11 HK   | 378,344.44   | 0.50 |

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 | 28,808,860.49 |
| 卖出收入（成交）总额 | 28,325,838.12 |

### 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    | 455.62 |
| 4  | 应收利息    | 544.03 |
| 5  | 应收申购款   | -      |
| 6  | 其他应收款   | -      |
| 7  | 待摊费用    | -      |
| 8  | 其他      | -      |
| 9  | 合计      | 999.65 |

**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:本基金本报告期末指数投资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:本基金本报告期末积极投资前五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<br>户数(户) | 户均持有的基金份<br>额 | 持有人结构        |                       |              |                   |   |                       |
|--------------|---------------|--------------|-----------------------|--------------|-------------------|---|-----------------------|
|              |               | 机构投资者        |                       | 个人投资者        |                   | 中国工商银行股份有限<br>公司-南方恒生交易型<br>开放式指数证券投资基<br>金联接基金 |                       |
|              |               | 持有份额         | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) | 持有份额         | 占总份<br>额比例<br>(%) | 持有份额  | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) |
| 856          | 33,679.32     | 1,130,372.00 | 3.92                  | 6,930,252.00 | 24.04             | 20,768,876.00                                   | 72.04                 |

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称                                      | 持有份额(份)       | 占上市总份额比例(%) |
|----|--|---------------|-------------|
| 1  | 南京盛泉恒元投资有<br>限公司-盛泉恒元多<br>策略量化套利1号专<br>项基金 | 1,000,000.00  | 3.47        |
| 2  | 邓永平  | 373,908.00    | 1.30        |
| 3  | 贺自强  | 300,000.00    | 1.04        |
| 4  | 陈远亮  | 289,300.00    | 1.00        |
| 5  | 谢凤祺  | 269,900.00    | 0.94        |
| 6  | 高增荣  | 191,611.00    | 0.66        |
| 7  | 刘兴玥  | 158,200.00    | 0.55        |
| 8  | 焦金玲  | 150,000.00    | 0.52        |
| 9  | 姚晓琴  | 140,000.00    | 0.49        |
| 10 | 刘隽永  | 131,100.00    | 0.45        |
| 11 | 南方恒生交易型开放<br>式指数证券投资基金<br>联接基金             | 20,768,876.00 | 72.04       |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金情况

注:本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、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。

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注: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(2014年12月23日)<br>基金份额总额 | 286,959,921.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 28,829,500.00  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 9,000,000.00   |
| 减:本报告期基金总赎回份额                  | 9,000,000.00   |
| 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                   | 28,829,500.00  |

### § 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未发生重大人事变动。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

#### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

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30000.00元,该审计机构已提供审计服务的连续年限为4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 |    |
| 华泰证券 | 2      | 57,134,698.61 | 100.00%      | 45,759.44 | 100.00%    | -  |
| 中投证券 | 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 | 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 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
|------|------|--------------|------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| 华泰证券 | -    | -            | -    | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中投证券 | -    | -            | -    | -              | -    | -            | -    | -            |

## § 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 (%) |
| 联接基金  | 1              | 20180101-20181231       | 18,919,176.00 | 5,081,600.00 | 3,231,900.00 | 20,768,876.00 | 72.04    |
| 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。 |                |                         |               |              |              |               |          |

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。