

代销券商及其他代销机构：

序号	代销机构名称	代销机构信息	
1	华泰证券股份有限公司	注册地址：南京市江东中路228号 法定代表人：周易 联系人：嵇晓芸 联系电话：0755-82492193 客服电话：96687 网址：www.htsc.com.cn	
2	兴业证券股份有限公司	注册地址：福州市湖东路268号 办公地址：上海市浦东新区长杨路36号 法定代表人：杨华辉 联系人：乔雪雷 联系电话：021-38566547 客服电话：96662 网址：www.xysc.com.cn	
3	中国银河证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街35号2-6层 办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座 法定代表人：陈共炎 联系人：李国政 联系电话：010-83574507 客服电话：4008-888-888或95551 网址：www.chinastock.com.cn	
4	国泰君安证券股份有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号 办公地址：上海市浦东新区银城中路168号 法定代表人：杨德红 联系人：芮敏骀 电话：021-38676666 客服电话：4008888666 网址：www.gtja.com	
5	中泰证券股份有限公司	注册地址：济南市市中区经七路86号 办公地址：山东省济南市市中区经七路86号 法定代表人：李玮 联系人：吕海华 电话：021-20315290 传真：021-20315137 客服电话：96538 网址：www.zts.com.cn	
6	海通证券股份有限公司	注册地址：上海市广东路689号 办公地址：上海市广东路689号 法定代表人：周杰 电话：021-23219000 传真：021-23219100 联系人：李奕鸣 客服电话：95553 网址：www.htsc.com	
7	中信建投证券股份有限公司	注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼 办公地址：北京市朝阳区门内大街188号 法定代表人：王常青 联系人：刘杨 联系电话：010-65068231 客服电话：4008888108 网址：www.csc108.com	
8	广发证券股份有限公司	注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室 办公地址：广州市天河区河北路183号大都会广场5、7、8、17、18、19、38—44楼 法定代表人：孙树明 联系人：黄真 客服电话：95575或致电各地营业网点 网址：广发证券网http://www.gf.com.cn	
9	长城证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层 办公地址：深圳市福田区深南大道特区报业大厦14、16、17层 法定代表人：丁益 联系人：金夏 联系电话：0755-83516289 客服电话：0755-3368000 400666888 网址：www.cgws.com.cn	
10	招商证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—46层 法定代表人：霍达 联系人：黄婵君 联系电话：0755-82960167 客服电话：96066, 4008881111 网址：www.newone.com.cn	
11	中信证券股份有限公司	注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座 办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人：张佑君 联系人：郑慧 电话：010-60834817 传真：010-60833739 客服电话：96668 网址：www.csc10.com	
12	申万宏源证券有限公司	注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层 办公地址：上海市徐汇区长乐路989号40层 法定代表人：李梅 联系人：王宇璇 电话：021-33398988 传真：021-33388224 客服电话：95523或4008886523 网址：www.swhysc.com	
13	光大证券股份有限公司	注册地址：上海市静安区新闸路1508号 办公地址：上海市静安区新闸路1508号 法定代表人：薛峰 联系人：何耀 联系电话：021-22169999 客服电话：96525 网址：www.ebscn.com	
14	中国中投证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第40层01、02、03、06、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元 办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层 法定代表人：高涛 联系人：万玉琳 联系电话：0755-82026907 传真：0755-82026339 客服电话：400-600-8008, 95532 网址：www.china-invsc.com	
15	申万宏源西部证券有限公司	注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 法定代表人：韩志坚 电话：0991-5801913 传真：0991-5801466 联系人：王怀春 客服电话：400-800-0662 网址：www.hysec.com.cn	
16	安信证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦36层、28层A02单元 办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦1楼9层 法定代表人：王连志 联系人：陈剑虹 联系电话：0755-82825551 客服电话：4008001001 网址：www.essence.com.cn	
17	中信证券（山东）有限责任公司	注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心A座16层 办公地址：山东省青岛市市南区东海西路20号龙翔广场东座5层 法定代表人：姜晓林 联系人：刘晓明 联系电话：0631-89606165 客服电话：95548 网址：www.citicsd.com	
18	中银国际证券有限责任公司	注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F 法定代表人：李敬 联系人：王倩君 联系电话：021-20328309 客服电话：4006208888 网址：www.bocichina.com	
19	信达证券股份有限公司	注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 法定代表人：张志刚 联系人：尹旭航 联系电话：010-63081000 传真：010-63080978 客服电话：95321 网址：www.cindasc.com	
20	华西证券股份有限公司	注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 法定代表人：杨炯洋 联系人：魏国梅 联系电话：010-52723273 客服电话：96584 网址：www.hx168.com.cn	
21	长江证券股份有限公司	注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦 法定代表人：李新华 联系人：奚博宇 电话：027-65799599 传真：027-86481300 客服电话：96579或4008-888-999 网址：www.95578.com	
22	东北证券股份有限公司	注册地址：长春市生态大街6666号 办公地址：长春市生态大街6666号 法定代表人：李福春 联系人：安岩岩 联系电话：0431-85096517 客服电话：96360 网址：www.nesc.com	
23	国联证券股份有限公司	注册地址：江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街8号7-9层 办公地址：江苏省无锡市滨湖区太湖新城金融一街8号7-9层 法定代表人：姚志勇 联系人：祁斌 联系电话：0510-82831662 客服电话：95270 网址：www.glsc.com.cn	
24	东莞证券股份有限公司	注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心 办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心 联系人：李荣 联系电话：0769-22115712 传真：0769-22115712 客服电话：83289 网址：www.dgzq.com.cn	
25	渤海证券股份有限公司	注册地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室 办公地址：天津南开区滨水道6号 法定代表人：王春峰 联系人：蔡鹏 电话：022-28451891 传真：022-28451832 客服电话：400-651-5888 网址：www.bhsc.com.cn	
26	平安证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区中心区金田路4036号超大厦16-20层 办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号超大厦16-20层 法定代表人：刘世安 联系人：周一峰 联系电话：021-39837436 客服电话：95511-8 网址：stock.pingan.com	
27	东吴证券股份有限公司	注册地址：苏州工业园区星阳街5号 办公地址：苏州工业园区星阳街5号 法定代表人：范力 联系人：叶晓丹 电话：0512-65581136 传真：0512-65588921 客服电话：95330 网址：www.dwzq.com.cn	
28	广州证券股份有限公司	注册地址：广州市天河区珠江江西路6号广州国际金融中心主塔19楼、20楼 办公地址：广州市天河区珠江江西路6号广州国际金融中心主塔19楼、20楼 法定代表人：胡欣云 联系人：戴薇 联系电话：95368 客服电话：95368 网址：www.gzs.com.cn	
29	华安证券股份有限公司	注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1层 法定代表人：李工 联系人：陈磊 联系电话：0651-65618121 客服电话：95318 网址：www.hazq.com	
30	国盛证券有限责任公司	注册地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦 办公地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦 法定代表人：徐义峰 联系人：周欣荣 联系电话：0791-86281305 客服电话：4008222111 网址：www.gssec.com	
31	大同证券有限责任公司	注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层 办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座F12、F13 法定代表人：董祥银 联系人：薛伟 电话：0351-4130222 传真：0351-4192803 客服电话：4007121212 网址：http://www.dtsbc.com.cn	
32	新时代证券股份有限公司	注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 法定代表人：叶卿德 联系人：田芳芳 联系电话：010-85611466 客服电话：95399 网址：www.xdszq.com	
33	恒泰证券股份有限公司	注册地址：呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座14层 办公地址：呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座14层 法定代表人：庞介民 联系人：陈楠 客服电话：4001968188 网址：www.hntsc.com.cn	
34	大通证券股份有限公司	注册地址：辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座—大连期货大厦38、39层 办公地址：大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层 法定代表人：赵强 联系人：谢立军 电话：0411-39991807 传真：0411-39991833 客服电话：4008-169-169 网址：www.dtsbc.com.cn	
35	东兴证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层 办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层 法定代表人：魏庆华 联系人：董悦 电话：010-65550079 传真：010-65551333 客服电话：95309 网址：www.dxzq.net	
36	联储证券有限责任公司	注册地址：广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座29楼 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路333号金领大厦8楼 法定代表人：李勇明 联系人：丁倩云 电话：010-56177851 传真：010-56177855 客服电话：400-620-6888 网址：www.lfzq.com	
37	川财证券有限责任公司	注册地址：中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区交子大道177号中海国际中心B座17楼 办公地址：中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区交子大道177号中海国际中心B座17楼 法定代表人：孟建军 联系人：匡静 电话：028-86583053 传真：028-86583002 客服电话：95105118 网址：www.cczq.com	
38	中信期货有限公司	注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1306室、14层 办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1306室、14层 法定代表人：张皓东 联系人：刘宏安 电话：010-60833754 传真：0755-83217421 客服电话：400-990-8826 网址：http://www.citicsf.com	
39	上海好买基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号 办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号万都国际大厦903-906室；上海市虹口区欧阳路196号（兰乔创意园）26号楼2楼 法定代表人：杨文斌 联系人：张茹 电话：021-20613899 传真：021-68596916 客服电话：400-700-9655 网址：www.howbuy.com	
40	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	注册地址：杭州市余杭区仓前文一西路1218号1栋202室 办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F 法定代表人：陈柏青 联系人：张敬彬 联系电话：4000-766-123 网址：www.fund123.cn	
41	上海天天基金销售有限公司	注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层 办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座大厦（东方财富大厦） 法定代表人：其实 联系人：黄妮娟 电话：021-54509898 传真：021-64883038 客服电话：96321 网址：www.1234567.com.cn	
42	浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址：杭州市余杭区仓前文一西路1218号1栋202室 办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F 法定代表人：凌顺平 联系人：吴强 电话：0571-88911818-8853 传真：0571-88004223 客服电话：4008-773-772 网址：www.5ifund.com	
43	上海陆金所基金销售有限公司	注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼 法定代表人：胡学勤 联系人：李雨霏 电话：021-20699562 传真：021-22066653 客服电话：4008219031 网址：www.lufunds.com	
44	珠海盈米财富管理有限公司	注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491 办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203室 法定代表人：肖雯 联系人：邵湘湘 电话：020-89620999 传真：020-89629011 客服电话：020-89620666 网址：www.yingmi.com	
45	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号 办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号 法定代表人：钱昊飞 联系人：王峰 电话：025-66966699-887226 传真：025-66966699 客服电话：95177 网址：www.snjfund.com	
46	上海煜基基金销售有限公司	注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘公桥1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区） 办公地址：上海市昆明路518号北美广场A栋1002-1003室 法定代表人：王翔 联系人：李蔚 电话：021-36385621 传真：021-56886991 客服电话：400-1020-5369 网址：www.jiyufund.com.cn	
47	北京肯特瑞财富投资管理有限公司	注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2803-06 办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街18号院京东总部17层 法定代表人：江卉 联系人：徐佰宇 电话：010-89183566 电话：010-89183566 传真：010-89183566 客服电话：95118 网址：jr.jd.com	
48	大河财富基金销售有限公司	注册地址：贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场15楼20层12号 办公地址：贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场15楼20层12号 联系人：王庆 联系人：董建 电话：0851-89466605 传真：0851-89466602 客服电话：0851-82236678 网址：www.urainf.com	
49	本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告		

3.2 登记机构

名称：南方基金管理股份有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层

法定代表人：张海波

电话：（0755）82763849

传真：（0755）82763868

联系人：占莉娟

3.3 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

联系人：丁煜

电话：（86 21）3135 8666

传真：（86 21）3135 8600

经办律师：黎明、丁煜

3.4 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展业银行大厦6楼

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：陈嘉

经办注册会计师：薛竞、陈嘉

5 4 基金名称

5 5 基金的类型

混合型基金

5 6 基金的投资目标

本基金在严格控制风险的前提下,力争获得长期稳定的投资收益。

5 7 基金的投资范围

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）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人将在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围, 并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为0—30%。开放期内, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%, 在封闭期内, 本基金不受上述5%的限制。

5 8 基金的投资策略

8.1 投资策略

1、资产配置策略

本基金通过定性方法与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势, 评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险, 据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例, 在保持总体风险水平相对稳定的基础上, 力争投资组合的稳定增值。此外, 本基金将持地进行定期与不定期的资产配置风险监控, 适时地做出相应的调整。

2、股票投资策略

本基金依托于基金管理人的投资研究平台, 紧密跟踪中国经济结构转型的改革方向, 努力探寻在调结构、促改革中具备长期价值增长潜力的上市公司。股票投资采用定量和定性分析相结合的策略。基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性, 对组合进行优化, 在合理风险水平下追求基金收益最大化, 同时监控组合中证券的估值水平, 在市场价格明显高于其内在合理价值时适时卖出证券。

3、债券投资策略

在选择债券品种时, 首先根据宏观经济、资金面动向、发行人情况和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化, 并充分考虑组合的流动性管理的实际情况, 进行债券组合的久期; 其次, 结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置; 再次, 在上述基础上利用债券定价技术选择个券, 选择被价格低估的债券进行投资。

本基金投资于中小企业私募债券。由于中小企业私募债券整体流动性相对较差, 且整体信用风险相对较高。中小企业私募债券的这个特点要求在具体的投资过程中, 应采取更为谨慎的投资策略。本基金投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面, 并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素, 确定最终的投资决策。

4、权证投资策略

本基金在进行权证投资时, 将通过对权证标的证券基本面的研究, 并结合权证定价模型寻求其合理估值水平, 并充分考虑权证资产的流动性、风险性特征, 并综合运用策略包括: 价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。

5、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资策略关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析, 本基金将在国内资产证券化产品体系政策框架下, 采用基本分析和数量化模型相结合, 对个券进行风险分析和价格评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资, 以降低流动性风险。

6、开放期投资策略

本基金以定期开放方式运作, 即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内, 基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性, 以应对当时市场条件下的赎回要求, 并降低资产的流动性风险, 做好流动性管理。

今后, 随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等, 基金还将积极寻求其他投资机会, 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 本基金将在履行适当程序后, 将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

8.2 投资决策依据和决策程序

1、决策依据

（1）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提；

（2）宏观经济形势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本基金投资决策的基础；

（3）投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策, 是本基金维护投资人利益的重要保障。

2、决策程序

（1）决定主要投资原则: 投资决策委员会决定基金的主要投资原则, 并对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。

（2）提出投资建议: 研究员以外部的研究报告以及其他信息来源作为参考, 对市场进行研究, 提出市场运行趋势的分析观点, 在重点关注的投资产品范围内根据自己的研究提出有投资价值的各类证券向基金经理提出投资建议。研究员根据基金经理提出的要求对各类投资品种进行研究并给出投资建议。

（3）制定投资建议: 基金经理在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下, 根据研究员提供的投资建议以及自己的分析判断, 做出具体的投资决策。

（4）进行风险评估: 风险管理部门对公司旗下基金投资组合的风险进行监测和评估, 并出具风险监控报告。

（5）评估和调整决策程序: 基金管理人有权根据环境的变化和实际的需要调整决策的程序。

5 9 基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×20%+ 中债综合指数收益率×80%

沪深300指数是中证指数有限公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数, 科学地反映了我国证券市场的整体业绩表现, 具有一定的权威性和市场代表性, 业内也普遍采用。因此, 沪深300指数是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。

中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制, 样本债券涵盖范围广, 适合作为一个最具一般性的业绩比较基准。因此, 中债综合指数是衡量本基金债券投资业绩的理想基准。

如果今后法律法规发生变化, 或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出, 或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时, 本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下, 报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告, 无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时, 基金管理人可以按相关监管部门要求履行相关手续后, 依据维护基金份额持有人合法权益的原则, 选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数, 而无需召开基金份额持有人大会。

5 10 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金, 其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金, 高于债券型基金、货币型基金。

5 11 基金投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和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, 投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至2017年12月31日（未经审计）。

1.1 报告期末基金资产组合情况

序号

项目

金额（人民币元）

占基金总资产的比例（%）

1

权益投资

—

—

其中：股票

—

—

2

基金投资

—

—

3

固定收益投资

633,970,900.00

97.99

其中：债券

594,146,900.00

91.84

资产支持证券

39,824,000.00

6.16

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

4,114,769.45

0.64

8

其他资产

8,894,049.15

1.37

合计

646,989,719.02

100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

1.2.2 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投资股票。

1.3 报告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

注：本基金本报告期末未持有股票。

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
其中：政策性金融债	—	—	—
4	企业债券	154,328,900.00	38.20
5	企业短期融资券	119,656,000.00	29.67
6	中期票据	76,044,000.00	19.46
7	可转换（可交换）债	—	—
8	同业存单	241,358,000.00	59.74
9	其他	—	—
合计		594,146,900.00	147.07

1.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111709453	17浦发银行CD453	500,000	48,760,000.00	12.07
1	11171142	17平安银行CD452	500,000	48,760,000.00	12.07
1	111710600	17兴业银行CD360	500,000	48,760,000.00	12.07
4	011760126	17冀中能源SCP005	300,000	29,973,000.00	7.42
5	112566	17洪桥01	300,000	29,349,000.00	7.25

1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	146013	恒顺1RA1	200,000	19,914,000.00	4.93
2	146129	花冠27A1	200,000	19,910,000.00	4.93

1.7 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。

1.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货投资。</

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

1.2.2 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。

1.3 报告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

注：本基金本报告期末未持有股票。

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

1.4.1 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债券投资明细

序号

债券品种

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

1

国家债券

—

—

2

央行票据

—

—

3

金融债券

—

—

其中：政策性金融债

—

—

4

企业债券

154,328,900.00

38.20

5

企业短期融资券

119,866,000.00

29.67

6

中期票据

78,604,000.00

19.46

7

可转债（可交换债）

—

—

8

同业存单

241,368,000.00

59.74

9

其他

—

—

合计

594,146,900.00

147.07

1.5 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债券投资明细

序号

债券代码

债券名称

数量(张)

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

1

111709463

17浦发银行CD463

500,000

48,760,000.00

12.07

1

111711462

17平安银行CD462

500,000

48,760,000.00

12.07

1

111710600

17兴业银行CD600

500,000

48,760,000.00

12.07

4

011760126

17冀中能源SCP2006

300,000

29,973,000.00

7.42

5

112596

17招商01

300,000

29,349,000.00

7.28

1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号

证券代码

证券名称

数量（份）

公允价值（人民币元）

占基金资产净值比例（%）

1

146013

鹏华16A1

200,000

19,974,000.00

4.93

2

146128

招商17A1

200,000

19,910,000.00

4.93

1.7 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。

1.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金报告期内未投资股指期货。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金报告期内未投资国债期货。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1

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。

1.11.2

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。

1.11.3 其他资产构成

序号

名称

金额（人民币元）

1

存出保证金

50,640.02

2

应收证券清算款

—

3

应收股利

—

4

应收利息

8,823,409.13

5

应收申购款

—

6

其他应收款

—

7

待摊费用

—

8

其他

—

合计

8,884,049.15

1.11.4 报告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。

1.11.5 报告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。

5 12 基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、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, 也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险, 投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

南方荣年A

阶段

净值增长率①（%）

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（%）

2017/07/13（基金合同生效日）

—

—

—

—

—

—

2017/12/31

0.84

0.06

0.69

0.14

0.15

-0.08

南方荣年C

阶段

净值增长率①（%）

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（%）

2017/07/13（基金合同生效日）

—

—

—

—

—

—

2017/12/31

0.56

0.06

0.69

0.14

-0.13

-0.08

5 13 基金的费用概览

13.1 与基金运作有关的费用

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、基金相关账户的开户及维护费用；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定, 可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.