

[illegible]

2017年12月31日被审计为104.04%。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。

5.0.3 其他资产构成及构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	--
2	应收证券清算款	8,772,323.28
3	应收利息	159,168,230.22
4	应收申购款	63,949,097.96
5	其他应收款	--
6	预付款项	--
7	其他	--
8	合计	231,887,161.46

5.0 开放式基金份额变动

项目	期初基金份额A	期初基金份额B	期末基金份额A	期末基金份额B
报告期期初基金份额总额	673,077,284.70	19,011,770,848.22	826.17	--
报告期基金已申购份额	417,377,960.10	19,281,742,715.17	--	9.43
报告期基金已赎回份额	441,384,090.40	11,647,832,221.89	--	111.46
报告期期末基金份额总额	646,491,114.40	26,646,081,842.60	826.17	733.15

5.1 基金管理人运用固有资金投资本基金或买卖本公司管理的基金份额及基金管理人运用固有资金买卖本公司、基金、买卖本基金份额。

5.2 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 中国证监会核准南方基金现金增利证券投资基金募集的文件;
- 南方基金现金增利南方市场基金现金增利基金合同;
- 南方基金现金增利南方市场基金托管协议;
- 南方基金现金增利南方市场基金招募说明书;
- 基金管理人业务资格和资质、营业执照;
- 存续地点

广州市天河区珠江新城东圃路30号广州银行大厦40-43楼。

8.2 备查文件

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

南方基金管理有限责任公司  
二〇一八年七月十九日

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,186,021.01
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收利息	6,307,115.33
5	应收申购款	115,689,789.49
6	其他应收款	-
7	待转款项	-
8	其他	-
9	合计	124,892,931.83

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限原因
1	000648	泸州老窖	29,225,000.00	0.17	非公开发行股票
2	000683	泸州老窖	27,656,000.00	0.16	非公开发行股票

注：根据《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，大股东以外的股东减持所持有的上市公司非公开发行股票，自取得集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%。持有上市公司非公开发行股票股份的股东，通过集中竞价交易减持该部分股份的，除遵守前款规定外，自股份解除限售之日起12个月内，减持数量不得超过其持有该次非公开发行股票数量的50%。

§ 6 开放式基金份额变动

	单位：份
报告期期初基金份额总额	7,773,756,276.34
报告期基金份额申购份额	2,188,075,770.75
减：报告期基金总额赎回份额	1,897,941,634.43

报告期间基金拆分变动总额	
报告期末基金份额总额	7,173,880.41366

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达消费行业股票型证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达消费行业股票型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 4.《易方达消费行业股票型证券投资基金托管协议》；
- 5.基金管理人业务资格批件和营业执照。
- 8.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40—43楼。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司  
二〇一八年七月十九日

<b>5.10.2 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。</b>			
<b>5.10.3 其他各项资产构成</b>			
序号	名称	金额(人民币元)	
1	存出保证金	—	
2	应收证券清算款	1,040,690.07	
3	应收股利	730,819.04	
4	应收利息	2,266.31	
5	应收申购款	136,772.82	
6	其他应收款	—	
7	待摊费用	—	
8	其他	—	
9	合计	1,909,644.18	

**5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期内未持有处于转股期的可转换债券。

**5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期内前十名股票中不存在流通受限情况。

**§ 6 开放式基金份额变动**

单位：元

报告期期初基金份额总额	91,790,536.00
报告期内基金总申购份额	4,387,980.97
减：报告期内基金份额赎回	50,763,009.97
报告期内基金净申购份额	45,414,557.00
报告期末基金份额总额	46,405,416.73

**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

**§ 8 影响投资者决策的其他重要信息**

**8.1 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及基金份额占比基本情况				
	序号	持有基金份额达到或超过20%的时间区间	申购份额	赎回份额	持有份额 份额占比
机构	1	2018年04月01日至 2018年06月26日	20,001,944.00	—	20,001,944.00
	2	2018年04月01日至 2018年06月26日	21,102,300.00	—	21,102,300.00

**产品特有风险**

报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:该投资者持有份额占比为集中时,个别投资者的行为可能会对基金资产运作及净值表现产生影响;极端情况下,基金管理人有可能无法以合理价格及时变现基金资产以对投资者的赎回申请,从而导致流动性风险;该个别投资者的大额赎回可能对投资组合回报产生不利影响。根据基金合同约定的特定情形下赎回限制或者接受受基金的限制而暂停,可能影响投资人赎回基金份额,故存在因流动性风险管理方式,与其他基金合并计算后,本基金总资产大于6000万元,基金仓位可能突破投资运作方式,与其他基金合并计算后,本基金总资产持有基金份额比例较高的投资者在已持仓并对其进行买入时进行投票表决时可享有同等权利未达预期。

**注:**申购份额包括申购或者买入基金份额,赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

**§ 9 备查文件目录**

**9.1 备查文件目录**

1.中国证监会注册编号广东香港恒生综合小型股指数证券投资证券投资基金（LOF）募集说明书全文；

2.《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资证券投资基金（LOF）基金合同》；

3.《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资证券投资基金（LOF）托管协议》；

4.基金管理人业务资格条件和营业执照。

**9.2 存放地点**

广州市天河区珠江新城东圃路30号广州银行大厦40-43楼。

**9.3 查阅方式**

投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司  
二〇一八年七月十九日