

南方绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

2018年半年度报告摘要

基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告日期:2018年08月27日

1.1 重要提示
基金管理人、南方基金管理股份有限公司的董事会、董事对基金本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。
本报告度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告度财务报告未经审计。
本报告按照2018年1月1日起至6月30日止。
2.基金简介
2.1 基金基本情况

基金名称	南方绝对收益策略定期混合
基金简称	南ABS
基金运作方式	定期开放运作
基金合同生效日	2014年12月11日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	389,441,679.97份
基金合同存续期限	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“南方绝对收益”。

2.2 基金产品说明
投资目标:本基金通过多种投资策略对冲本基金的系统性风险,寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略:本基金力争通过合理判断市场走势,合理配置股票、股指期货、债券等多种资产,力争实现基金资产的长期增值。本基金采用“自上而下”的资产配置策略,在控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准:中国证监会发布的同一时期定期存款基准利率(税后)+2%
风险收益特征:本基金为特殊类型的混合型基金,通过运用多种投资策略降低市场系统性风险,追求相对收益,本基金属于中低风险的基金品种,其预期风险和收益水平高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金,因此不能保证一定获利或超越业绩比较基准的绝对收益。

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	中国建设银行股份有限公司
姓名	党彦华	田申
联系电话	0755-82763888	010-67596006
电子邮箱	manager@southernfund.com	tsunqj@ccb.com
客户服务热线	400-889-8899	010-67596006
传真	0755-82763889	010-66276263

2.4 信息披露方式
信息披露半年度报告正文的互联网网址: <http://www.sfnfund.com>
基金半年度报告备置地点:基金管理人、基金托管人的办公地点

3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期初余额和指标	报告期(2018年01月01日至2018年06月30日)
本期已实现收益	15,073,677.20
本期利润	527,441.34
加权平均基金份额本期利润	0.0015
本基金份额净值增长率	2.38%
3.1.2 期末余额和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2447
期末基金资产净值	484,783,043.34
期末基金份额净值	1.2447

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表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低(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	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④
过去一个月	-0.22%	0.18%	0.01%	-0.17%
过去三个月	-1.37%	0.14%	0.01%	-1.13%
过去六个月	2.38%	0.31%	1.56%	0.30%
过去一年	9.44%	0.31%	3.19%	0.20%
过去三年	11.23%	0.21%	10.36%	0.08%
自基金合同生效以来	28.04%	0.27%	13.27%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来本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



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、深圳等地设有分公司,在香港和前海设有子公司——南方东莞资产管理有限公司(香港子公司)和南方基金管理有限公司(深圳子公司)。其中,南方东莞是国内基金公司注册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7,900亿元,旗下管理167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产品组合。
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	在本基金的基金经理(助理)任职日期	证券从业年限	说明
曹伟亮	本基金基金经理	2016年12月30日	8	美国加州大学圣地亚哥分校金融工程硕士,注册金融分析师(CFP),2011年加入南方基金,任量化投资部副经理,2016年12月至今,任南方绝对收益策略定期混合基金基金经理,2016年12月至今,任南方绝对收益策略定期混合基金基金经理,2017年11月至今,任本基金基金经理,2018年11月至今,任本基金基金经理。

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”分别指其根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
2.分别指基金公司的合法存续以及行业协会《证券基金从业人员资格管理办法》的相关规定。
3. 2. 基金管理人对其报告期内基金运作遵守信用的说明
本报告期间,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《南方绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金合同》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,没有发生损害基金份额持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。
4.3 管理人对其报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 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间执行股票和债券的同一交易价差专项分析。本报告期间,内两组合间单日、3日、6日期间窗口内同交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值不大于0%的情况不存在,并且交易占比优势也没有明显异常,未发现不公平对待各投资组合间相互利益输送的情况。
4.3.2 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均未超过该证券当日成交量的5%。
4.4 管理人对其报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2018年上半年,本基金投资主要包括量化对冲操作,新股申购及回购定存等现金管理,量化对冲部分:使用量化选股模型构建股票多头组合,同时使用股指期货对冲市场系统性风险,以赚取组合相对期货超额收益为主。现金管理部分:交易回购与定存存款相结合,持续获取现金管理收益。
4.4.2 报告期内基金的投资表现
截至报告期末,本基金份额净值为1.2447元,报告期内,份额净值增长率为2.38%,同期业绩比较基准增长率为1.56%。
4.5 管理人对其对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
2018年上半年,受到海外主要经济体货币政策逐步收紧、中美贸易争端等诸多不确定因素影响,中国经济增速面临较大压力。权益市场缺乏赚钱效应,同时市场情绪趋弱,市场处于探底筑底过程中。权益市场年初至今经历了三波下跌,风险得到充分释放,目前权益市场估值水平已经有相当的吸引力,投资价值凸显。权益市场短期存在不确定性风险,但长期持有有利机会较大,未来收益可期。
4.6 管理人对其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新准则、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的业务处理流程,明确基金估值程序和标准,建立了估值委员会,组成人员包括副总经理、督察长,制度研究部总经理、指数数据部总经理、风险管理部总经理、风险管理部副经理等。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评估、控制和其他相关事项。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%以上时,对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性

增税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]6号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于上市公司固定资产进项税抵扣有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:
(a)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、债券转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货币期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的买入价计算净值。非货币期货结算价格作为买入价计算销售额。
(b)对基金从证券市场取得的收入,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。
(c)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;持股期限超过1个月的,自2015年1月1日起,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,持股期限自解禁日起计算,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%的税率计算个人所得税。
(d)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。

(e)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳的增值税额的适用比例计算缴纳。
6.4.4 关联方关系
6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关系方发生变化的情况
本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关系方未发生变化。
6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人,登记机构,基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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

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. 关联方基金管理人根据《南方基金管理股份有限公司基金合同》,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。
6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.5.1.1 股票交易

关联方名称	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
成交金额	369,857,275.97	483,916,033,294.86
占当期股票成交总额的比例(%)	48.38	51.05

6.4.5.1.2 权证交易
注:无。
6.4.5.1.3 应支付关联方的佣金

关联方名称	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期佣金	36,981.39	48,377.02
占当期佣金总额的比例(%)	88.57	92.06

注:1.上述佣金参考市场报价经本基金的基金管理人及与对方协商确定,以扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的证券登记和手续费的净佣示。
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。
6.4.5.2 关联方报酬
6.4.5.2.1 基金管理费

项目	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
本报告期发生的基金应支付的基金管理费	3,800,774.90	1,806,926.76
未支付基金管理费	98,501.03	586,483.32
本报告期合计	489,753,043.34	281,586,878.76

注:1. 支付基金管理人南方基金的管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。
2. 在符合基金收益分配条件的情况下,在提取评价日(每个封闭期的最后一个工作日)计算并计提附加管理费,按照“新法原则”提取超额收益的10%作为附加管理费,次月一次性支付。
3. 本基金本报告期内计提附加管理费1,684,713.70元,上年度可比期间计提附加管理费1元。
6.4.5.2.2 基金托管费

项目	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
本报告期发生的基金应支付的托管费	629,015.28	461,482.19

注:支付基金托管人中国建设银行股份有限公司按前一日基金资产净值0.25%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 0.25% / 当年天数。
6.4.5.2.3 销售服务费
注:无。
6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
注:无。
6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
基金合同生效日(2014年12月11日)持有的基金份额	9,008,567.10	9,008,567.10
期初持有的基金份额	9,008,567.10	9,008,567.10
期间申购/买入份额	-	-
期间赎回/卖出份额	-	-
期末持有的基金份额	9,008,567.10	9,008,567.10
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.3100%	3.3400%

6.4.5.4.2 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
注:无。
6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
期末余额	10,467,666.69	14,362,300.00
当期利息收入	114,362.00	106,678.94

注:1. 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
注:无。
6.4.5.7 其他关联交易事项的说明
注:无。
6.4.6 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

股票代码	证券名称	认购日期	可流通日期	受限类型	认购数量	期末数量	期末账面价值	期末占总市值比例	备注
603105	思创医惠	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	483	483	3,410	16	470.30
603708	东岳集团	2018-07-29	2018-07-29	新股认购	1369	1369	1,765	103.85	103.85

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	复牌日期	停牌原因	期末数量	期末账面价值	期末占总市值比例	备注	
000426	华发股份	2018-06-18	-	-	99,000	1,061,964.8	713	730.00	
000723	华锦股份	2018-03-27	2018-07-31	资产重组	439	400	249,242.00	285	242.00
000802	北京科锐	2018-06-12	-	-	9	605	306,673.30	312	900.00
000750	江华矿业	2018-04-30	2018-08-01	资产重组	1612	140	2,479,021	2,488,000	-
601717	上海电气	2018-06-06	2018-08-07	资产重组	571	21	423,600.00	135	676.00
600835	银轮机械	2018-04-03	1043	-	54	400	538,416.76	567	392.00

6.4 报表附注
6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致的说明
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保持一致。
6.4.2 差错更正的说明
本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。
6.4.3 税项
根据财政部、国家税务总局总局财税[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《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]12号《关于资管产品

增税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]6号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于上市公司固定资产进项税抵扣有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:
(a)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、债券转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货币期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的买入价计算净值。非货币期货结算价格作为买入价计算销售额。
(b)对基金从证券市场取得的收入,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。
(c)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;持股期限超过1个月的,自2015年1月1日起,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,持股期限自解禁日起计算,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%的税率计算个人所得税。
(d)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花,买入股票不征收股票交易印花。

(e)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳的增值税额的适用比例计算缴纳。
6.4.4 关联方关系
6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关系方发生变化的情况
本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关系方未发生变化。
6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人,登记机构,基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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

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. 关联方基金管理人根据《南方基金管理股份有限公司基金合同》,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。
6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.5.1.1 股票交易

关联方名称	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
成交金额	369,857,275.97	483,916,033,294.86
占当期股票成交总额的比例(%)	48.38	51.05

6.4.5.1.2 权证交易
注:无。
6.4.5.1.3 应支付关联方的佣金

关联方名称	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期佣金	36,981.39	48,377.02
占当期佣金总额的比例(%)	88.57	92.06

注:1.上述佣金参考市场报价经本基金的基金管理人及与对方协商确定,以扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的证券登记和手续费的净佣示。
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。
6.4.5.2 关联方报酬
6.4.5.2.1 基金管理费

项目	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
本报告期发生的基金应支付的基金管理费	3,800,774.90	1,806,926.76
未支付基金管理费	98,501.03	586,483.32
本报告期合计	489,753,043.34	281,586,878.76

注:1. 支付基金管理人南方基金的管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。
2. 在符合基金收益分配条件的情况下,在提取评价日(每个封闭期的最后一个工作日)计算并计提附加管理费,按照“新法原则”提取超额收益的10%作为附加管理费,次月一次性支付。
3. 本基金本报告期内计提附加管理费1,684,713.70元,上年度可比期间计提附加管理费1元。
6.4.5.2.2 基金托管费

项目	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
本报告期发生的基金应支付的托管费	629,015.28	461,482.19

注:支付基金托管人中国建设银行股份有限公司按前一日基金资产净值0.25%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 0.25% / 当年天数。
6.4.5.2.3 销售服务费
注:无。
6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
注:无。
6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
基金合同生效日(2014年12月11日)持有的基金份额	9,008,567.10	9,008,567.10
期初持有的基金份额	9,008,567.10	9,008,567.10
期间申购/买入份额	-	-
期间赎回/卖出份额	-	-
期末持有的基金份额	9,008,567.10	9,008,567.10
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.3100%	3.3400%

6.4.5.4.2 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
注:无。
6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
期末余额	10,467,666.69	14,362,300.00
当期利息收入	114,362.00	106,678.94

注:1. 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
注:无。
6.4.5.7 其他关联交易事项的说明
注:无。
6.4.6 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

股票代码	证券名称	认购日期	可流通日期	受限类型	认购数量	期末数量	期末账面价值	期末占总市值比例	备注
603105	思创医惠	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	483	483	3,410	16	470.30
603708	东岳集团	2018-07-29	2018-07-29	新股认购	1369				