南方安养混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:南方基金管理股份有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2019年03月27日

§1 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。

基金托管人中国交通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02月06日(合同生效日)起至2018年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方安养混合
基金主代码	005397
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月6日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	213,432,528.71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“南方安养”。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	陆志俊
	联系电话	0755-82763888	95559
	电子邮箱	manager@southernfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-889-8899	95559
传真		0755-82763889	021-62701216

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02月06日(基金合同生效日)-2018年12月31日
本期已实现收益	3,337,202.07
本期利润	-1,332,996.01
加权平均基金份额本期利润	-0.0053
本期基金份额净值增长率	-0.75%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0075
期末基金资产净值	211,823,429.46
期末基金份额净值	0.9925

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。

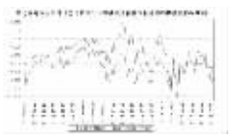
4.本基金合同于2018年2月6日生效,截至本报告期末成立未满1年,本报告期为非完整会计年度。

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

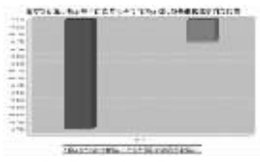
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.09%	0.38%	-0.39%	0.24%	-1.70%	0.14%
过去六个月	-1.31%	0.33%	0.13%	0.22%	-1.44%	0.11%
自基金合同生效起至今	-0.75%	0.26%	-0.15%	0.21%	-0.60%	0.05%

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



注:本基金合同于2018年2月6日生效,截至本报告期末基金成立未满一年;自基金成立日起6个月内为建仓期,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



注:本基金于2018年2月6日成立,截至本报告期末成立未满1年,故本报告期净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2018年2月6日成立,自基金合同生效以来未进行利润分配。

§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		
吴剑毅	本基金基金经理	2018年2月6日	-	10	清华大学金融学硕士,具有基金从业资格。2009年7月加入南方基金,任南方基金研究部金融行业研究员;2012年3月至2014年7月,担任南方避险、南方保本基金经理助理;2015年11月至2017年12月,任南方顺康保本基金经理;2014年7月至2018年1月,任南方恒元基金经理;2015年9月至2018年11月,任南方消费活力基金经理;2015年10月至2018年11月,任南方顺达保本基金经理;2015年5月至今,任南方利众基金经理;2015年7月至今,任南方利达基金经理;2015年11月至今,任南方利安基金经理;2016年12月至今,任南方安颐混合基金经理;2017年8月至今,任南方金融混合基金经理;2017年11月至今,任南方安福混合基金经理;2017年12月至今,任南方顺康混合基金经理;2018年2月至今,任南方安养混合基金经理;2018年11月至今,任南方中小盘成长股票基金经理。

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 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,并且交易占优比也没有明显异常,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

2018年, 国内经济下行压力加大,GDP同比增长6.6%,并呈现逐季回落趋势;在经济增速放缓、中美贸易摩擦加剧、债券违约事件频发以及股权质押风险暴露等多因素影响下,股票市场在1月短暂上扬后,步入单边下跌行情,报告期内上证综指下跌24.59%,创业板指下跌28.65%,沪深300指数下跌25.31%。 报告期内,市场的全面下跌为获取绝对收益增加了难度, 我们结合市场环境保持较为灵活的股票仓位,重点在低估值或者估值相比国际水平有提升空间的板块中选择优质个股。固定收益投资方面,随着长端利率债收益率的下行,我们对当前长债持谨慎态度,组合整体固收资产配置以获取持有到期收益为主。

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0.9925元,报告期内,份额净值增长率为-0.75%,同期业绩基准增长率为-0.15%。

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,经济仍然存在下行压力,贸易战的影响也将延续和反复,但在中美双方均面临经济放缓的情况下, 双方仍有较强动力在谈判中达成协议。政策方面,国内政策定向宽松持续推进,而美联储加息和收表态度在松动,给国内信用扩张提供了政策空间;减税方案也有望逐步落地,预计较长时间内政策将维持友好态势。最后,从资金面上看,以外资为首的增量资金仍在源源不断进入市场,有利于优质个股持续企稳上涨。 尽管经济及盈利增长压力增大, 不确定性因素仍较多,但我们应该看到,当前A股整体市盈率估值已经回落至历史较低位置,众多指标均指向市场处于底部区域。虽然低估值并不必然意味着市场将上涨,但往往是获取高回报的基础。一直以来我们都坚持绝对收益选股需要寻找收敛机制,而最确定的收敛机制恰恰是时间,市盈率正是时间的代表,它代表了我们的投资回收年限,更是获取高股息的基础。低估值的公司,只要业绩保持稳定,最终每年业绩的增长将会体现到公司价值的提升, 进而反应到股价的上涨。 在系统性风险不大的前提下,我们认为市场的结构性行情仍将持续,配置上重点考虑两个方面的思路。一是当前股息收益率高的股票,只要盈利及分红比例能够保持稳定,那么就将吸引理财等固收类资金持续买入。另一类是估值相比国际水平低估或者稀缺的品种,它们将吸引大量的外资持续买入。随着沪港通、MSCI资金的流入,A股原本相对封闭的估值体系被打破,逐步融入国际市场中的一员,投资者结构逐步成熟,估值水平相对国际偏低的板块将继续获得估值提升的机会。

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。

4.8 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

2018年度,基金托管人在南方安养混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2018年度,南方基金管理股份有限公司在南方安养混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

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

2018年度,由南方基金管理股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关南方安养混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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23118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:南方安养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	本期末 2018年12月31日
资 产:	
银行存款	1,410,083.11
结算备付金	456,269.40
存出保证金	33,700.44
交易性金融资产	214,150,194.00
其中:股票投资	43,666,694.00
基金投资	-
债券投资	170,483,500.00
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	297,881.20
应收利息	4,592,060.67
应收股利	-
应收申购款	913.69
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	220,941,102.51
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	8,000,000.00
应付证券清算款	316,921.09
应付赎回款	202,263.89
应付管理人报酬	185,368.47
应付托管费	37,073.69
应付销售服务费	-
应付交易费用	65,984.42
应交税费	3,558.81
应付利息	11,046.56
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	295,456.12
负债合计	9,117,673.05
所有者权益:	
实收基金	213,432,528.71
未分配利润	-1,609,099.25
所有者权益合计	211,823,429.46
负债和所有者权益总计	220,941,102.51

注: 1.报告截止日2018年12月31日,基金份额净值0.9925元,基金份额总额213,432,528.71份。

2.本财务报表的实际编制期间为2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:南方安养混合型证券投资基金

本报告期:2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日
一、收入	2,314,508.50
1.利息收入	8,212,048.72
其中:存款利息收入	48,052.73
债券利息收入	6,734,714.69
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,429,281.30
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-1,357,845.34
其中:股票投资收益	-2,076,153.60
基金投资收益	-
债券投资收益	34,356.56
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	683,951.70
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-4,670,198.08
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	130,503.20
减:二、费用	3,647,504.51
1. 管理人报酬	2,265,691.71
2. 托管费	453,138.36
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	370,545.69
5. 利息支出	230,016.58
其中:卖出回购金融资产支出	230,016.58
6. 税金及附加	4,851.54
7. 其他费用	323,260.63
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-1,332,996.01
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-1,332,996.01

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方安养混合型证券投资基金

本报告期:2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年2月6日(基金合同生效日)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)	278,830,087.99	-	278,830,087.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,332,996.01	-1,332,996.01
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)	-65,397,559.28	-276,103.24	-65,673,662.52
其中:1.基金申购款	4,647,181.48	39,057.21	4,686,238.69
2.基金赎回款	-70,044,740.76	-315,160.45	-70,359,901.21
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)	213,432,528.71	-1,609,099.25	211,823,429.46

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 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

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 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。

7.4.1.3 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。

7.4.2 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。

7.4.3 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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司	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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,265,691.71
其中:支付销售机构的客户维护费	1,019,123.63

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×1.00%/当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	453,138.36

注: 支付基金托管人交通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×0.20%/当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

无。

7.4.4.5 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2月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	1,410,083.11	25,396.21

注:本基金由基金托管人交通银行保管的银行存款,按银行约定利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.5.3.2 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8,000,000.00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。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为43,666,694.00元, 属于第二层次的余额为170,483,500.00元,无属于第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	43,666,694.00	19.76
	其中:股票	43,666,694.00	19.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	170,483,500.00	77.16
	其中:债券	170,483,500.00	77.16
	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	1,866,352.51	0.84
8	其他各项资产	4,924,556.00	2.23
9	合计	220,941,102.51	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	903,276.00	0.43
C	制造业	27,576,056.08	13.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,416,312.00	0.67
F	批发和零售业	1,926,544.00	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	675,367.00	0.32
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	8,704,438.12	4.11
K	房地产业	205,146.00	0.10
L	租赁和商务服务业	1,731,924.80	0.82
M	科学研究和技术服务业	527,630.00	0.25
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	43,666,694.00	20.61

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	256,448	3,831,333.12	1.81
2	601009	南京银行	549,400	3,549,124.00	1.68
3	600066	宇通客车	179,500	2,127,075.00	1.00
4	600741	华域汽车	114,900	2,114,160.00	1.00
5	600056	中国医药	150,900	1,896,813.00	0.90
6	000333	美的集团	51,000	1,879,860.00	0.89
7	002027	分众传媒	330,520	1,731,924.80	0.82
8	600519	贵州茅台	2,908	1,715,749.08	0.81
9	600068	葛洲坝	224,100	1,416,312.00	0.67
10	603589	口子窖	40,100	1,406,307.00	0.66

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	4,872,089.00	2.30
2	601398	工商银行	3,884,666.00	1.83
3	000651	格力电器	3,878,569.46	1.83
4	601009	南京银行	3,688,297.37	1.74
5	002027	分众传媒	3,674,300.28	1.73
6	000333	美的集团	3,308,788.17	1.56
7	600741	华域汽车	3,058,243.35	1.44
8	600066	宇通客车	2,856,133.00	1.35
9	000786	北新建材	2,643,919.64	1.25
10	000568	泸州老窖	2,632,167.00	1.24
11	600028	中国石化	2,621,757.00	1.24
12	600887	伊利股份	2,587,919.02	1.22
13	600056	中国医药	2,454,927.00	1.16
14	601288	农业银行	2,410,043.00	1.14
15	002304	洋河股份	2,404,340.00	1.14
16	600519	贵州茅台	2,399,249.86	1.13
17	600176	中国巨石	2,180,366.98	1.03
18	603368	柳药股份	2,057,891.76	0.97
19	601636	旗滨集团	1,957,400.00	0.92
20	600068	葛洲坝	1,854,567.00	0.88

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	2,992,258.00	1.41
2	601288	农业银行	2,425,743.00	1.15
3	000651	格力电器	2,356,444.00	1.11
4	600028	中国石化	2,045,579.00	0.97
5	601211	国泰君安	1,766,128.00	0.83
6	000961	中南建设	1,710,675.00	0.81
7	600702	舍得酒业	1,675,202.00	0.79
8	600048	保利地产	1,519,366.00	0.72
9	002304	洋河股份	1,511,739.00	0.71
10	000725	京东方A	1,507,206.00	0.71
11	601169	北京银行	1,473,117.00	0.70
12	000028	国药一致	1,396,253.00	0.66
13	300571	平治信息	1,169,680.00	0.55
14	000786	北新建材	1,162,255.00	0.55
15	002236	大华股份	1,118,515.00	0.53
16	601939	建设银行	1,111,497.72	0.52
17	600597	光明乳业	1,096,739.00	0.52
18	600176	中国巨石	1,067,238.00	0.50
19	002247	聚力文化	1,020,235.78	0.48