南方瑞合三年定期开放混合型发起式证券投资基金(LOF) 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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2019年03月27日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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。

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。

基金托管人中国建设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9月6日(基金合同生效日)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	南方瑞合三年定期开放混合
场内简称	南方瑞合三年
基金主代码	501062
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年9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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,433,264,165.68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	2018年12月5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“南方瑞合”。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,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,本基金将持续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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,一般而言,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资港股通股票,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67595096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	010-67595096
传真		0755-82763889	010-66275853

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09月06日(基金合同生效日)-2018年12月31日
本期已实现收益	-46,590,604.46
本期利润	-62,122,859.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0433
本期基金份额净值增长率	-4.33%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末
期末可供分配利润	-62,122,859.22
期末基金资产净值	1,371,141,306.46
期末基金份额净值	0.9567

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

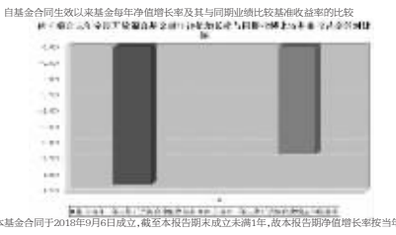
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-4.85%	0.62%	-6.16%	0.90%	1.31%	-0.28%
自基金合同生效起至今	-4.33%	0.55%	-4.00%	0.86%	-0.33%	-0.31%

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9月6日生效,截至本报告期末基金成立未满一年;本基金成立之日起至报告期末未满6个月。

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:本基金合同于2018年9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

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运作经验

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		
史博	本基金基金经理	2018年9月6日	-	20	特许金融分析师(CFA),硕士学历,具有基金从业资格。曾任职于博时基金管理有限公司、中国人寿资产管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司。2004年7月至2005年2月,任泰达周期基金经理;2007年7月至2009年5月任泰达首选基金经理;2008年8月至2009年9月任泰达市值基金经理;2009年4月至2009年9月任泰达品质基金经理。2009年10月加入南方基金,现任南方基金副总裁兼首席投资官(权益),资产配置委员会主席,境内权益投资决策委员会主席,国际投资决策委员会主席、公募业务协同发展委员会副主席。2014年2月至2018年11月,任南方新优享基金经理;2015年9月至2018年11月,任南方消费活力基金经理;2011年2月至今,任南方绩优基金经理;2017年3月至今,任南方智慧混合基金经理;2018年5月至今,任南方瑞祥一年混合基金经理;2018年9月至今,任南方瑞合基金经理。

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;对此后的由首任基金经理,“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 管理人对投资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 管理人对投资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,以及投权、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组合、投资管理制度和期货、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、交易执行的内控控制,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,两两组合间甲日、乙日、丙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

回顾2018年,在金融去杠杆、经济增速放缓的内部环境和中美同易摩擦等外部不确定因素中,市场呈现全面下跌,全年沪深300指数下跌25.31%,风险偏好持续下降。国内宏观经济数据增速回落,美国经济韧性见顶风险。我们在建仓后保持稳定的仓位,维持了低估值高分红龙头公司的核心持仓。同时,我们对部分超跌股票适度加仓。在政策托底与经济基本面下行阶段,股票市场大概率维持底部震荡的态势。随着改革的深入与经济下探见底预期增强,市场大幅下跌的风险暂时减弱。本基金在2018年末已完成债券与核心股票持仓的配置,在市场底部区域,预期的不确定性会加大市场的波动与恐慌,我们将更加坚定持有能够抵御经济周期波动,质地良好的龙头公司,以更长的视角去进行投资的判断与决策。

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0.9567,报告期内,份额净值增长率-4.33%,同期业绩基准增长率-4.00%

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,实际和名义GDP增速在上半年大概率延续回落,无风险利率仍然有下行空间,三大需求投资、消费、进出口都以乐观、谨慎风险偏好,谨慎风险折价,但随着政策托底的加强,风险溢价也有望下行。在2018年的基础上,我们将在控制风险的前提下,在2019年初全球风险资产的反弹中,我们看到我国资本市场对外部冲击开始逐渐免疫。在一个股票估值便宜,货币政策宽松且风险溢价下行预期的时点,信用扩张可能会带来整体风险偏好的提升,我们保持观望,并认为这将成为市场的上涨信号。一季度,我们永续债的推出以及ETC等票据互换工具的创新为2019年宽信用打下了坚实基础,中美两国货币市场对即将到来的贸易磋商有良好预期,给国内市场风险偏好的提升创造了条件,我们对2019年一季度的A股市场偏乐观。操作上,对于基本面良好,长期价值凸现的股票的,应敢于下跌中加仓,投长时间看得见的龙头公司,以更长的视角去进行投资的判断与决策。

4.4.3 报告期内基金份额持有人结构

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
48,563	29,513.50	43,715,148.33	3.05	1,389,549,017.35	96.95

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,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10%,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,登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值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;登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式。具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;由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;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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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。

§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23167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:南方瑞合三年定期开放混合型发起式证券投资基金(LOF)

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	23,318,978.94
结算备付金	26,010,312.91
存出保证金	1,004,853.92
交易性金融资产	1,049,380,350.74
其中:股票投资	401,779,552.74
基金投资	-
债券投资	647,600,798.00
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	270,000,000.00
应收证券清算款	259,089.03
应收利息	8,793,405.16
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	1,378,766,990.70

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	-
应付证券清算款	23.11
应付赎回款	-
应付管理人报酬	6,644,513.19
应付托管费	292,163.14
应付销售服务费	-
应付交易费用	486,129.16
应交税费	37,855.64
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	165,000.00
负债合计	7,625,684.24
所有者权益:	
实收基金	1,433,264,165.68
未分配利润	-62,122,859.22
所有者权益合计	1,371,141,306.46
负债和所有者权益总计	1,378,766,990.70

注:1.报告截止日2018年12月31日,基金份额净值0.9567元,基金份额总额1,433,264,165.68份。

2.本财务报表的实际编制期间为2018年9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:南方瑞合三年定期开放混合型发起式证券投资基金(LOF)

本报告期:2018年9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9月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日
一、收入	-52,858,089.86
1.利息收入	6,886,202.93
其中:存款利息收入	1,021,674.46
债券利息收入	2,891,516.49
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	2,973,011.98
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-44,240,703.31
其中:股票投资收益	-44,391,314.25
基金投资收益	-
债券投资收益	150,610.94
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	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-15,532,254.76
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	28,665.28
减:二、费用	9,264,769.36
1. 管理人报酬	6,644,513.19
2. 托管费	1,107,418.82
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	1,333,252.73
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 税金及附加	7,414.21
7. 其他费用	172,170.41
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-62,122,859.22
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-62,122,859.22

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方瑞合三年定期开放混合型发起式证券投资基金(LOF)

本报告期:2018年9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9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)	1,433,264,165.68	-	1,433,264,165.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-62,122,859.22	-62,122,859.22
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	1,433,264,165.68	-62,122,859.22	1,371,141,306.46

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 基金基本情况

南方瑞合三年定期开放混合型发起式证券投资基金(LOF)(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[2018]942号《关于准予南方瑞合三年定期开放混合型发起式证券投资基金(LOF)注册的批复》核准,由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方瑞合三年定期开放混合型发起式证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,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1,432,765,840.21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(2018)第0526号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方瑞合三年定期开放混合型发起式证券投资基金(LOF)基金合同》于2018年9月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,433,264,165.68份,其中认购资金利息折合498,325.47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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,002,700.27份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《南方瑞合三年定期开放混合型发起式证券投资基金(LOF)基金合同》和《南方瑞合三年定期开放混合型发起式证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定,本基金自基金合同生效后,每三年开放一次申购和赎回。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]146号核准,本基金257,023,883.00份基金份额于2018年12月6日在上交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至上交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方瑞合三年定期开放混合型发起式证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为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)、沪港通股票(仅投资香港联交所上市的股票及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。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
活期存款	23,318,978.94
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	23,318,978.94

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2018年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		416,912,342.82	401,779,552.74	-15,132,790.08
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	428,729,649.41	427,886,498.00	-843,151.41
	银行间市场	219,270,613.27	219,714,300.00	443,686.73
	合计	648,000,262.68	647,600,798.00	-399,464.68
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,064,912,605.50	1,049,380,350.74	-15,532,254.76

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注:无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位:人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
交易所市场	270,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	270,000,000.00	-

注:交易所买入返售证券余额中包含的交易所场内质押式协议回购的余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注:无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
应收活期存款利息	9,734.71
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	13,468.23
应收债券利息	8,821,924.53
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-51,817.79
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	95.48
合计	8,793,405.16

7.4.7.6 其他资产

注:无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	483,136.82
银行间市场应付交易费用	2,992.34
合计	486,129.16

7.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	165,000.00
合计	165,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2018年9月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,433,264,165.68	1,433,264,165.68
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,433,264,165.68	1,433,264,165.68

注:1.本基金自2018年8月6日至2018年8月31日止期间公开发售,共募集有效净认购资金人民币1,432,765,840.21元,折合为1,432,765,840.21份基金份额。根据《南方瑞合三年定期开放混合型发起式证券投资基金(LOF)招募说明书》的规定,本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币501,247.96元在本基金成立后,折合为498,325.47份基金份额,归基金份额持有人所有,余额计入基金资产。

2.根据《南方瑞合三年定期开放混合型发起式证券投资基金(LOF)基金合同》和《南方瑞合三年定期开放混合型发起式证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定,本基金自基金合同生效后,每三年开放一次申购和赎回。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。

3.截至2018年12月31日止,本基金于上交所上市的基金份额为259,857,052.00份,托管在场外未上市交易的基金份额为1,173,407,113.68份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统,可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回;未上市的基金份额登记在注册登记系统,按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 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
本期利润	-46,590,604.46	-15,532,254.76	-62,122,859.22
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中:基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-46,590,604.46	-15,532,254.76	-62,122,859.22

7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2018年9月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日
活期存款利息收入	912,242.98
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	103,980.26
其他	5,451.22
合计	1,021,674.46

7.4.7.12 股票投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2018年9月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日
卖出股票成交总额	251,475,816.62
减:卖出股票成本总额	295,867,130.87
买卖股票差价收入	-44,391,314.25

7.4.7.13 债券投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2018年9月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	133,980,992.60
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	131,767,683.57
减:应收利息总额	2,062,698.09
买卖债券差价收入	150,610.94

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注:无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注:无。

7.4.7.15 衍生工具收益

注:无。

7.4.7.16 股利收益

注:无。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2018年9月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日
1.交易性金融资产	-15,532,254.76
股票投资	-15,132,790.08
债券投资	-399,464.68
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	-15,532,254.76

7.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2018年9月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日
基金赎回费收入	-
基金合同生效前利息收入	28,665.28
合计	28,665.28

7.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

项目	本期 2018年9月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日
交易所市场交易费用	1,330,860.23
银行间市场交易费用	2,392.50
合计	1,333,252.73

7.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2018年9月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日
审计费用	90,000.00
信息披露费	75,000.00
银行费用	6,770.41
其他	400.00
合计	172,170.41

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 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、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
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年9月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
华泰证券	629,549,161.89	65.31

7.4.10.1.2 权证交易

注:无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年9月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总额的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
华泰证券	568,119.12	65.34	286,578.98	59.32

注:1.上述佣金按市场佣金率计算。

2.该类佣金扣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。

7.4.10.2 关联方投酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年9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	6,644,513.19
其中:支付销售机构的客户维护费	-

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提,逐日累计至每个封闭期的最后一日,在每个封闭期的最后一日,若基金份额的期末净值小于或等于期初净值,则该封闭期及前一开放期(若有)内的管理费全额返还至基金资产;否则在该封闭期结束后5个工作日内支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.50%/ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年9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	1,107,418.82

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费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 × 0.25%/ 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年9月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日
基金合同生效日(2018年9月6日)持有的基金份额	10,002,700.27
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	10,002,700.27
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.70%

注:基金管理人南方基金投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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