南方安心保本混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：南方基金管理股份有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司
报告送出日期：2018年10月26日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24日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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方安心保本混合
基金主代码	202213
交易代码	202213
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月21日
报告期末基金份额总额	2,874,157,326.58份
投资目标	本基金在保障保本周期到期时本金安全的前提下，有效控制风险，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金按照时间不变性投资组合保险（TIPP，TimeInvariantPortfolioProtection）策略进行资产配置，以实现保本和增值的目标。TIPP策略设置了一条保本投资底线，该底线随着投资组合收益的增加而调整。TIPP策略改进了CPPI中保本投资底线的调整方式，每当收益率达到一定的比率并持续一段时间后，保本投资底线相应提高一定比例，以锁定一部分前期投资收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：三年期定期存款税后收益率+0.5%。
风险收益特征	本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
基金保证人	重庆市三峡融资担保集团股份有限公司

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"南方安心"。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年7月1日－2018年9月30日）
1.本期已实现收益	7,917,058.78
2.本期利润	10,686,139.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0037
4.期末基金资产净值	3,002,365,562.08
5.期末基金份额净值	1.045

1、上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；

2、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。

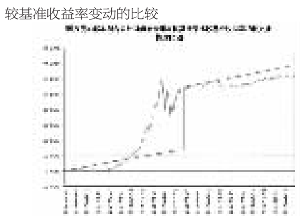
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	0.38%	0.10%	0.76%	0.01%	-0.38%	0.09%

根据《南方安心保本混合型证券投资基金基金合同》以及《南方安心保本混合型证券投资基金保本期到期操作规则及转入下一保本期的相关规则的提示性公告》的相关规定，本基金的第一个保本期为三年，自2012年12月21日至2015年12月21日止；第二个保本期为三年，自2015年12月29日至2018年12月29日止。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
卢玉珊	本基金基金经理	2015年12月30日	-	10年	女，清华大学会计学硕士，具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金，历任研究部研究员、高级研究员，负责纺织服装、商贸零售的行业研究工作；2015年2月至2015年12月，任南方成份、南方安心的基金经理助理；2015年5月至2015年12月，任南方改革机遇的基金经理助理；2015年12月至今，任南方安心基金经理。

1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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 公平交易专项说明

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。

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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4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 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾三季度，wind全a下跌4.81%，其中上证50上涨5.11%，沪深300下跌2.05%，创业板下跌12.16%，分化较大。分行业看，银行/石化/保险分别上涨12.41%/11.6%和5.46%，家电/医药/电子分别下跌17.34%/14.34%14.91%。总体来看，大盘股的表现显著跑赢。

稳健资产方面，资金面较为宽松，债券市场收益率有较明显的下行。安心将于年底到期，受避险基金规定稳健资产不能低于80%占比的限制，无法配置久期偏长的债券。我们将到期债券转换为存单和短融，主要获得稳定的利息收入。

权益部分，我们重仓个股基本保持稳定，但仓位有所下降。在投资框架上，我们希望能够坚持低PE高ROE的选股策略，在低估值的基础上，选择ROE较高，尤其是趋势向上的公司。在行业配置上，主要仓位还是配置在了银行、食品饮料、家电以及与经济关联度较弱的消费品龙头的配置，增配了部分估值和业绩增速匹配度较好的成长股。在个股的选 择上，我们仍然坚持细分行业龙头，尤其是那些规模与盈利能力与第二名的优势在持续扩大的龙头。

4.5 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1.045元，报告期内，份额净值增长率为0.38%，同期业绩基准增长率为0.76%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	164,243,543.86	5.45
	其中：股票	164,243,543.86	5.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,492,977,800.00	82.65
	其中：债券	2,492,977,800.00	82.65
	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	280,000,000.00	9.28
	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	16,485,111.96	0.55
8	其他资产	62,535,963.74	2.07
9	合计	3,016,242,419.56	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	620,010.00	0.02
B	采矿业	613,473.00	0.02
C	制造业	86,411,796.23	2.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,183,838.00	0.07
E	建筑业	2,056,509.00	0.07
F	批发和零售业	3,901,944.88	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	7,463,488.40	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,724,706.00	0.16
J	金融业	50,765,676.35	1.69
K	房地产业	3,043,717.00	0.10
L	租赁和商务服务业	1,847,521.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	610,864.00	0.02
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	164,243,543.86	5.47

5.2.2 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投资股票。

5.3 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

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	1,040,700	16,599,165.00	0.55
2	000651	格力电器	265,425	10,670,085.00	0.36
3	000786	北新建材	617,561	10,245,336.99	0.34
4	601398	工商银行	1,676,000	9,670,520.00	0.32
5	002511	中顺洁柔	981,890	8,100,592.50	0.27
6	601288	农业银行	1,685,600	6,556,984.00	0.22
7	600872	中炬高新	157,900	5,147,540.00	0.17
8	601009	南京银行	638,300	4,882,995.00	0.16
9	000333	美的集团	109,700	4,615,079.00	0.15
10	601336	新华保险	89,800	4,533,104.00	0.15

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	160,435,000.00	5.34
	其中：政策性金融债	160,435,000.00	5.34
4	企业债券	372,051,800.00	12.39
5	企业短期融资券	685,031,000.00	22.82
6	中期票据	481,595,000.00	16.04
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	793,865,000.00	26.44
9	其他	-	-
10	合计	2,492,977,800.00	83.03

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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	111803165	18农业银行CD165	1,500,000	148,965,000.00	4.96
2	1182359	11中远MTN1	1,000,000	101,240,000.00	3.37
3	111812081	18北京银行CD081	1,000,000	96,790,000.00	3.22
4	136176	16绿地01	845,000	83,942,300.00	2.80
5	041764030	17徐工CP002	800,000	80,808,000.00	2.69

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货的投资应符合基金合同规定的保本策略和投资目标。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

（1）利用股指期货调整风险资产的比例和投资组合的β值

本基金管理人将根据TIPP策略与市场的变化不断调整风险资产和安全资产之间的比例。在需要调整风险资产的头寸时，本基金将适当通过买卖股指期货对风险资产头寸进行调整。当需要增加风险资产头寸时，通过做多股指期建立多头头寸；反之，当需要降低风险资产头寸时，通过做空股指期货建立股指期货空头头寸。另一方面，本基金管理人还将利用股指期货调整投资组合的β值，利用股指期货在弱市中降低风险资产组合的β值，在强市中提高风险资产组合的β值，以提升组合的业绩表现。

（2）α策略

在投资组合中分离出系统风险，寻求具有长期稳定的超额收益的投资品种，并利用股指期货规避股票市场的系统风险。

本基金的股指期货投资将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券除兴业银行（证券代码601166）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

兴业银行（证券代码601166）

该证券发行人于2018年5月4日发布公告称，因违反了《中华人民共和国商业银行法》、《中华人民共和国银行业监督管理法》等关于重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、无授信额度或超授信额度办理同业业务、内控管理严重违反审慎经营规则等行为，被银保监会公开处罚5870万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	96,121.66
2	应收证券清算款	613,493.11
3	应收股利	-
4	应收利息	61,826,348.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,535,963.74

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（%）	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	4,615,079.00	0.15	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,931,537,986.89
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	57,380,660.31
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,874,157,326.58

§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

本报告期末，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，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§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					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180701-20180930	909,360,275.00	0.00	0.00	909,360,275.00	31.64%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

申购份额包含红利再投资和份额折算。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《南方安心保本混合型证券投资基金基金合同》；

2、《南方安心保本混合型证券投资基金托管协议》；

3、南方安心保本混合型证券投资基金2018年3季度报告原文。

9.2 存放地点

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。

9.3 查阅方式

网站：http://www.nffund.com

南方安养混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期：2018年10月26日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24日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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方安养混合
基金主代码	005397
交易代码	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
报告期末基金份额总额	234,145,639.50份
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。
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

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"。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年7月1日－2018年9月30日）
1.本期已实现收益	409,569.97
2.本期利润	1,908,239.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0078
4.期末基金资产净值	237,357,297.94
5.期末基金份额净值	1.0137

注：1、上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；

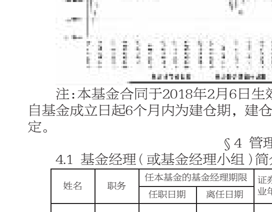
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	0.80%	0.28%	0.52%	0.20%	0.28%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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年	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9月至今，任南方消费活力基金经理；2015年10月至今，任南方顺达基金经理；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。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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 公平交易专项说明

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。

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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年3季度，国内经济整体维持平稳态势。报告期制造业PMI均值51.1%，较2季度下降0.5%，自2016年8月重返荣枯线水平后，已连续26个月站上荣枯线。尽管中美贸易摩擦形势愈演愈烈，目前尚未对我国出口产生实质不利影响，9月出口增速同比14.5%，显著高于市场预期。从全球环境来看，美国经济数据依然强劲，但除美国以外的经济体已开始面临下行压力。

市场方面，报告期内上证综指下跌0.92%，创业板指下跌12.16%，沪深300指数下跌2.05%，结构上延续了上半年的分化行情。银行、钢铁等低估值板块大幅跑赢市场，而医药、家电等上半年表现较好的板块开始补跌，表现欠佳。

报告期内本基金运作坚持以获取绝对收益为目标，在控制回撤的前提下，在市场下跌过程中适度提升了股票仓位，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以及美债收益率的上升，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。

展望4季度，我们认为市场上仍存在众多积极因素。首先，为对冲潜在经济下行，国内政策态度显著转暖，8月份资管新规落地好于预期，随后基建开始发力，又出台了减税、刺激消费等众多举措，后续更多的利好政策仍值得期待。其次，临近美国中期选举，中美贸易谈判或将取得阶段性进展，对市场情绪将有较大提振。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。

尽管今年以来A股市场的波动加大，但我们应该看到，当前A股整体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。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。典型的代表有银行和部分周期股。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，代表有家电和白酒。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。

4.5 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1.0137元，报告期内，份额净值增长率为0.80%，同期业绩基准增长率为0.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	50,267,069.70	19.86
	其中：股票	50,267,069.70	19.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	195,330,870.80	77.19
	其中：债券	195,330,870.80	77.19
	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	1,911,472.59	0.76
8	其他资产	5,543,115.10	2.19
9	合计	253,052,528.19	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	352,944.00	0.15
B	采矿业	-	-
C	制造业	36,322,208.50	15.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	890,838.00	0.38
F	批发和零售业	378,978.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	8,962,138.00	3.78
K	房地产业	424,733.00	0.18
L	租赁和商务服务业	2,331,910.20	0.98
M	科学研究和技术服务业	603,320.00	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	50,267,069.70	21.18

5.2.2 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投资股票。

5.3 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

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	272,500	4,346,375.00	1.83
2	000651	格力电器	95,400	3,835,080.00	1.62
3	000333	美的集团	62,300	2,620,961.00	1.10
4	002027	分众传媒	274,020	2,331,910.20	0.98
5	000568	泸州老窖	47,600	2,261,476.00	0.95
6	000786	北新建材	136,100	2,257,899.00	0.95
7	600887	伊利股份	84,200	2,162,256.00	0.91
8	601288	农业银行	553,400	2,152,726.00	0.91
9	600519	贵州茅台	2,900	2,117,000.00	0.89
10	600066	宇通客车	110,300	1,618,101.00	0.68

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	20,036,000.00	8.44
	其中：政策性金融债	15,073,500.00	6.35
4	企业债券	59,601,500.00	25.11
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	319,370.80	0.13
8	同业存单	115,374,000.00	48.61
9	其他	-	-
10	合计	195,330,870.80	82.29

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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	111821086	18渤海银行CD086	200,000	19,354,000.00	8.15
2	111816115	18上海银行CD115	200,000	19,242,000.00	8.11
3	111812091	18北京银行CD091	200,000	19,238,000.00	8.11
4	111894055	18南京银行CD044	200,000	19,190,000.00	8.08
5	111814042	18江苏银行CD042	200,000	19,180,000.00	8.08

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券除18杭州银行CD018（证券代码111893578）、18上海银行CD115（证券代码111816115）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、18杭州银行CD018（证券代码111893578）

2017年12月，杭州银行（600926）因涉及个人消费贷款资金流入股市、虚增存贷款、办理未发生现金转移的存取现业务等多项违规被处罚款140万元。

2、18上海银行CD115（证券代码111816115）

2018年1月，因上海银行对底层资产为非标准化债权资产的投资投前尽职调查严重不审慎，部分理财资金用于增资和缴交土地出让金，与合同约定用途不一致，上海银监局对上海银行下达行政处罚，责令改正，并处罚款人民币50万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	31,971.43
2	应收证券清算款	1,562,534.43
3	应收股利	-
4	应收利息	3,931,541.59
5	应收申购款	17,067.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,543,115.10

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127005	长证转债	319,370.80	0.13

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（%）	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	2,620,961.00	1.10	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	255,374,624.85
报告期期间基金总申购份额	636,614.92
减：报告期期间基金总赎回份额	21,865,600.27
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	234,145,639.50

§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

本报告期末，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，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过20%的情况

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《南方安养混合型证券投资基金基金合同》；

2、《南方安养混合型证券投资基金托管协议》；

3、南方安养混合型证券投资基金2018年3季度报告原文。

9.2 存放地点

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。

9.3 查阅方式

网站：http://www.nffund.com

南方安颐混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：南方基金管理股份有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2018年10月26日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月25日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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方安颐混合
基金主代码	003476
交易代码	003476
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月14日
报告期末基金份额总额	117,996,205.07份
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，为投资者提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金力图通过大类资产配置和精细化选股分享养老产业的成长红利。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，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，为投资者提供稳健的养老理财工具。
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。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

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"南方安颐混合"。2018年5月23日起，本基金的基金名称由"南方安颐养老混合型证券投资基金"变更为"南方安颐混合型证券投资基金"。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年7月1日－2018年9月30日）
1.本期已实现收益	-644,731.38
2.本期利润	1,298,858.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.0104
4.期末基金资产净值	119,519,985.53
5.期末基金份额净值	1.0129

注：1、上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；

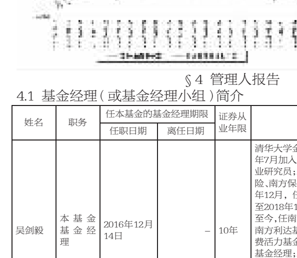
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	1.04%	0.29%	0.52%	0.20%	0.52%	0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2016年12月14日	-	10年	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9月至今，任南方消费活力基金经理；2015年10月至今，任南方顺达基金经理；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。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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 公平交易专项说明

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。

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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年3季度，国内经济整体维持平稳态势。报告期制造业PMI均值51.1%，较2季度下降0.5%，自2016年8月重返荣枯线水平后，已连续26个月站上荣枯线。尽管中美贸易摩擦形势愈演愈烈，目前尚未对我国出口产生实质不利影响，9月出口增速同比14.5%，显著高于市场预期。从全球环境来看，美国经济数据依然强劲，但除美国以外的经济体已开始面临下行压力。

市场方面，报告期内上证综指下跌0.92%，创业板指下跌12.16%，沪深300指数下跌2.05%，结构上延续了上半年的分化行情。银行、钢铁等低估值板块大幅跑赢市场，而医药、家电等上半年表现较好的板块开始补跌，表现欠佳。

报告期内本基金运作坚持以获取绝对收益为目标，在控制回撤的前提下，在市场下跌过程中适度提升了股票仓位，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以及美债收益率的上升，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。

展望4季度，我们认为市场上仍存在众多积极因素。首先，为对冲潜在经济下行，国内政策态度显著转暖，8月份资管新规落地好于预期，随后基建开始发力，又出台了减税、刺激消费等众多举措，后续更多的利好政策仍值得期待。其次，临近美国中期选举，中美贸易谈判或将取得阶段性进展，对市场情绪将有较大提振。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。

尽管今年以来A股市场的波动加大，但我们应该看到，当前A股整体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。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。典型的代表有银行和部分周期股。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，代表有家电和白酒。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。

4.5 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1.0129元，报告期内，份额净值增长率为1.04%，同期业绩基准增长率为0.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	24,907,269.56	19.01
	其中：股票	24,907,269.56	19.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	103,384,207.00	78.91
	其中：债券	103,384,207.00	78.91
	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	1,347,998.73	1.03
8	其他资产	1,374,154.26	1.05
9	合计	131,013,629.55	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	178,794.00	0.15
B	采矿业	-	-
C	制造业	18,079,275.76	15.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	349,920.00	0.29
F	批发和零售业	191,772.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	4,389,774.00	3.67
K	房地产业	225,145.00	0.19
L	租赁和商务服务业	1,181,868.80	0.99
M	科学研究和技术服务业	310,720.00	0.26
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	24,907,269.56	20.84

5.2.2 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投资股票。

5.3 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

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	128,400	2,047,980.00	1.71
2	000651	格力电器	48,300	1,941,660.00	1.62
3	000333	美的集团	34,300	1,443,001.00	1.21
4	002027	分众传媒	138,880	1,181,868.80	0.99
5	000786	北新建材	70,400	1,167,936.00	0.98
6	000568	泸州老窖	24,300	1,154,493.00	0.97
7	600887	伊利股份	44,600	1,145,328.00	0.96
8	601288	农业银行	278,900	1,084,921.00	0.91
9	600519	贵州茅台	1,400	1,022,000.00	0.86
10	600066	宇通客车	52,600	771,642.00	0.65

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	19,969,000.00	16.71
	其中：政策性金融债	10,044,000.00	8.40
4	企业债券	44,713,500.00	37.41
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	224,707.00	0.19
8	同业存单	38,477,000.00	32.19
9	其他	-	-
10	合计	103,384,207.00	86.50

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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	180407	18农发07	100,000	10,044,000.00	8.40
2	136510	16华电01	100,000	9,940,000.00	8.32
3	136544	16联通03	100,000	9,935,000.00	8.31
4	136682	G16三峡1	100,000	9,935,000.00	8.31
5	136830	16中信G1	100,000	9,925,000.00	8.30

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券除18杭州银行CD049（证券代码111899864）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2017年12月，杭州银行（600926）因涉及个人消费贷款资金流入股市、虚增存贷款、办理未发生现金转移的存取现业务等多项违规被处罚款140万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	15,031.80
2	应收证券清算款	285,165.27
3	应收股利	-
4	应收利息	1,073,706.50
5	应收申购款	250.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,374,154.26

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127005	长证转债	224,707.00	0.19

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（%）	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	1,443,001.00	1.21	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	131,309,812.64
报告期期间基金总申购份额	188,531.52
减：报告期期间基金总赎回份额	13,502,139.09
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	117,996,205.07

§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

本报告期末，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，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过20%的情况

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《南方安颐混合型证券投资基金基金合同》；

2、《南方安颐混合型证券投资基金托管协议》；

3、南方安颐混合型证券投资基金2018年3季度报告原文。

9.2 存放地点

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。

9.3 查阅方式

网站：http://www.nffund.com