

南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

| 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 | 100,000 | 0.04 |
| B | 采矿业 | 23,046,413.04 | 1.96 |
| C | 制造业 | 527,389,396.62 | 44.59 |
| D | 电力、热力、燃气及生产供应业 | 11,702,040.00 | 0.99 |
| F | 金融业 | 1,269,400.00 | 0.11 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 104,649,426.81 | 8.82 |
| I | 房地产业 | 142,393,092.00 | 12.07 |
| L | 租赁和商务服务业 | 12,097,042.81 | 1.01 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 12,985,012.00 | 1.10 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 建筑业 | - | - |
| P | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| Q | 综合 | 877,119,570.71 | 74.04 |

4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
 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，中国证监会和基金基金合同的有关规定，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有关规定。

4.2 公平交易专项说明
 4.2.1 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》，完善相关制度流程，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证券投资基金组合。

4.2.2 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超过该证券当日成交量5%的笔数共0次，是由于投资组合接受投资者申购后被动增仓以及投资组合的投资策略调整所致。

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》，完善相关制度流程，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证券投资基金组合。

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超过该证券当日成交量5%的笔数共0次，是由于投资组合接受投资者申购后被动增仓以及投资组合的投资策略调整所致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
 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，中国证监会和基金基金合同的有关规定，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有关规定。

4.5 报告期内基金业绩表现
 截至报告期末，本基金基金份额净值为1.156元，报告期内，份额净值增长率为-5.01%，同期业绩基准增长率为-0.76%。
 4.6 报告期内基金持有人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人数不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------|----------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 2 | 其中:股票 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 3.1 | 固定收益投资 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 3.1.1 | 其中:债券 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 180,000,000.00 | 15.12 |
| 6.1 | 其中:买入返售的法人机构款项 | - | - |
| 7 | 银行存拆款类资产合计 | 89,341,280.17 | 7.61 |
| 8 | 其他资产 | 38,508,072.14 | 3.29 |
| 9 | 其他负债 | 1,100,000.00 | 0.09 |
| 合计 | - | 1,180,500,000.00 | 100 |

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------|----------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 2 | 其中:股票 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 3.1 | 固定收益投资 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 3.1.1 | 其中:债券 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 180,000,000.00 | 15.12 |
| 6.1 | 其中:买入返售的法人机构款项 | - | - |
| 7 | 银行存拆款类资产合计 | 89,341,280.17 | 7.61 |
| 8 | 其他资产 | 38,508,072.14 | 3.29 |
| 9 | 其他负债 | 1,100,000.00 | 0.09 |
| 合计 | - | 1,180,500,000.00 | 100 |

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------|----------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 2 | 其中:股票 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 3.1 | 固定收益投资 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 3.1.1 | 其中:债券 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 180,000,000.00 | 15.12 |
| 6.1 | 其中:买入返售的法人机构款项 | - | - |
| 7 | 银行存拆款类资产合计 | 89,341,280.17 | 7.61 |
| 8 | 其他资产 | 38,508,072.14 | 3.29 |
| 9 | 其他负债 | 1,100,000.00 | 0.09 |
| 合计 | - | 1,180,500,000.00 | 100 |

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------|----------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 2 | 其中:股票 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 3.1 | 固定收益投资 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 3.1.1 | 其中:债券 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 180,000,000.00 | 15.12 |
| 6.1 | 其中:买入返售的法人机构款项 | - | - |
| 7 | 银行存拆款类资产合计 | 89,341,280.17 | 7.61 |
| 8 | 其他资产 | 38,508,072.14 | 3.29 |
| 9 | 其他负债 | 1,100,000.00 | 0.09 |
| 合计 | - | 1,180,500,000.00 | 100 |

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------|----------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 2 | 其中:股票 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 3.1 | 固定收益投资 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 3.1.1 | 其中:债券 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 180,000,000.00 | 15.12 |
| 6.1 | 其中:买入返售的法人机构款项 | - | - |
| 7 | 银行存拆款类资产合计 | 89,341,280.17 | 7.61 |
| 8 | 其他资产 | 38,508,072.14 | 3.29 |
| 9 | 其他负债 | 1,100,000.00 | 0.09 |
| 合计 | - | 1,180,500,000.00 | 100 |

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------|----------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 2 | 其中:股票 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 3.1 | 固定收益投资 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 3.1.1 | 其中:债券 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 180,000,000.00 | 15.12 |
| 6.1 | 其中:买入返售的法人机构款项 | - | - |
| 7 | 银行存拆款类资产合计 | 89,341,280.17 | 7.61 |
| 8 | 其他资产 | 38,508,072.14 | 3.29 |
| 9 | 其他负债 | 1,100,000.00 | 0.09 |
| 合计 | - | 1,180,500,000.00 | 100 |

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------|----------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 2 | 其中:股票 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 3.1 | 固定收益投资 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 3.1.1 | 其中:债券 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 180,000,000.00 | 15.12 |
| 6.1 | 其中:买入返售的法人机构款项 | - | - |
| 7 | 银行存拆款类资产合计 | 89,341,280.17 | 7.61 |
| 8 | 其他资产 | 38,508,072.14 | 3.29 |
| 9 | 其他负债 | 1,100,000.00 | 0.09 |
| 合计 | - | 1,180,500,000.00 | 100 |

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------|----------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 2 | 其中:股票 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 3.1 | 固定收益投资 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 3.1.1 | 其中:债券 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 180,000,000.00 | 15.12 |
| 6.1 | 其中:买入返售的法人机构款项 | - | - |
| 7 | 银行存拆款类资产合计 | 89,341,280.17 | 7.61 |
| 8 | 其他资产 | 38,508,072.14 | 3.29 |
| 9 | 其他负债 | 1,100,000.00 | 0.09 |
| 合计 | - | 1,180,500,000.00 | 100 |

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------|----------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 2 | 其中:股票 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 3.1 | 固定收益投资 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 3.1.1 | 其中:债券 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 180,000,000.00 | 15.12 |
| 6.1 | 其中:买入返售的法人机构款项 | - | - |
| 7 | 银行存拆款类资产合计 | 89,341,280.17 | 7.61 |
| 8 | 其他资产 | 38,508,072.14 | 3.29 |
| 9 | 其他负债 | 1,100,000.00 | 0.09 |
| 合计 | - | 1,180,500,000.00 | 100 |

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------|----------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 2 | 其中:股票 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 3.1 | 固定收益投资 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 3.1.1 | 其中:债券 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 180,000,000.00 | 15.12 |
| 6.1 | 其中:买入返售的法人机构款项 | - | - |
| 7 | 银行存拆款类资产合计 | 89,341,280.17 | 7.61 |
| 8 | 其他资产 | 38,508,072.14 | 3.29 |
| 9 | 其他负债 | 1,100,000.00 | 0.09 |
| 合计 | - | 1,180,500,000.00 | 100 |

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------|----------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 2 | 其中:股票 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 3.1 | 固定收益投资 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 3.1.1 | 其中:债券 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 180,000,000.00 | 15.12 |
| 6.1 | 其中:买入返售的法人机构款项 | - | - |
| 7 | 银行存拆款类资产合计 | 89,341,280.17 | 7.61 |
| 8 | 其他资产 | 38,508,072.14 | 3.29 |
| 9 | 其他负债 | 1,100,000.00 | 0.09 |
| 合计 | - | 1,180,500,000.00 | 100 |

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------|----------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 2 | 其中:股票 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 3.1 | 固定收益投资 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 3.1.1 | 其中:债券 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 180,000,000.00 | 15.12 |
| 6.1 | 其中:买入返售的法人机构款项 | - | - |
| 7 | 银行存拆款类资产合计 | 89,341,280.17 | 7.61 |
| 8 | 其他资产 | 38,508,072.14 | 3.29 |
| 9 | 其他负债 | 1,100,000.00 | 0.09 |
| 合计 | - | 1,180,500,000.00 | 100 |

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------|----------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 2 | 其中:股票 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 3.1 | 固定收益投资 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 3.1.1 | 其中:债券 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 180,000,000.00 | 15.12 |
| 6.1 | 其中:买入返售的法人机构款项 | - | - |
| 7 | 银行存拆款类资产合计 | 89,341,280.17 | 7.61 |
| 8 | 其他资产 | 38,508,072.14 | 3.29 |
| 9 | 其他负债 | 1,100,000.00 | 0.09 |
| 合计 | - | 1,180,500,000.00 | 100 |

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------|----------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 2 | 其中:股票 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 3.1 | 固定收益投资 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 3.1.1 | 其中:债券 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 180,000,000.00 | 15.12 |
| 6.1 | 其中:买入返售的法人机构款项 | - | - |
| 7 | 银行存拆款类资产合计 | 89,341,280.17 | 7.61 |
| 8 | 其他资产 | 38,508,072.14 | 3.29 |
| 9 | 其他负债 | 1,100,000.00 | 0.09 |
| 合计 | - | 1,180,500,000.00 | 100 |

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|-------|---------|----------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 2 | 其中:股票 | 877,119,570.71 | 74.03 |
| 3 | 基金投资 | - | - |
| 3.1 | 固定收益投资 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 3.1.1 | 其中:债券 | 18,613,277.00 | 1.59 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售 | | |