

南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告



注:1.本基金从2017年12月11日起实施资产配置,3月份自2018年12月1日起生效。
2.本基金转型日期为2014年7月24日,该日起原南方基金原油股票型证券投资基金正式变更为南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金。

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时间	证券从业年限	说明
廖晓	本基金基金经理	2015年5月20日至今	9年	清华大学管理学与工程专业硕士,具有证券从业资格和证券投资基金从业资格,曾任招商证券研究员,高级研究员,2014年3月至2014年6月,任招商证券研究员,2014年6月至2015年4月,任招商证券高级研究员,2015年4月至2016年12月,任招商证券高级研究员,2016年12月至今,任南方基金基金经理,2018年3月至今,任南方基金基金经理。

注:1.本基金基金经理的任职日期为公募基金合同生效日,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募基金相关决议作出决定的公告(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。
3.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约定。
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,公平对待旗下基金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
本报告期内,本基金不存在异常交易行为。本报告期内本基金管理人管理的所有的投资组合与交易对手开收盘价间同日交易成交较少的单边交易金额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购后被动调仓所致。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
三季度,国内与国外形势都面临一定压力,国内经济增速放缓,尤其消费增速

创历史新高,代表性的汽车消费有较大程度下滑,显示出居民在较高的杠杆水平下购买力受到抑制。国内主要中美贸易摩擦升温,美国政府在本季度不断加大对美国加征关税,并在其他方面对中国投资进行阻碍,影响了国内市场的风险偏好。双重重压下,国内权益市场整体疲弱,除了石化、金融等板块外,大部分板块呈现下跌趋势。报告期内,本基金仓位上保持较低仓位,仓位控制得当,资产组合中,通信行业行业龙头的配置。同时考虑到石化行业的资本开支提前回补,是为数不多的景气度还在上升的行业,我们增加了石化能源上游设备的配置。
截至报告期末,本基金A份额净值为1.357元,报告期内,份额净值增长率为-7.75%,同期业绩比较基准增长率为-1.61%;本基金C份额净值为1.349元,报告期内,份额净值增长率为-7.92%,同期业绩比较基准增长率为-1.81%。
4.6 报告期内本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基金资产净值低于五千万元的情况。

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	258,017,124.22	79.56
2	其中:股票	258,017,124.22	79.56
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	30,241,651.80	9.32
5	其中:债券	30,241,651.80	9.32
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买入返售金融资产	-	-
10	其他资产	34,337,062.52	10.00
11	合计	322,615,838.54	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	81.80	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	231,707,031.16	71.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,000,048.00	0.93
E	建筑业	679.02	0.00
F	交通运输、仓储和邮政业	1,932.28	0.00
G	信息、计算机、软件和信息技术服务业	90,419.17	0.03
H	金融业	2,084.22	0.00
I	房地产业	120,062.26	0.04
J	批发和零售业	-	-
K	住宿和餐饮业	177,428.41	0.05
L	租赁和商务服务业	2,084.22	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	74,700.00	0.02
O	教育、体育和娱乐业	-	-
P	医药制造业	-	-
Q	卫生和社会工作	1,189.44	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,527.94	0.00
S	其他	-	-
合计		258,017,124.22	79.56

5.3 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	180299	汇博股份	300,000	30,051,000.00	9.30
2	113617	曙光软件	1,740	100,651.80	0.06

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

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	180299	汇博股份	300,000	30,051,000.00	9.30
2	113617	曙光软件	1,740	100,651.80	0.06

5.9 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内,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,基金管理人未存在申购、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.《南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
2.《南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
3.南方高端装备灵活配置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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-1,477,486.71	-6,772.37
2.本期利润	-27,179,674.77	-74,015.26
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1140	-0.1149
4.期末基金份额净值	322,389,281.79	819,046.00
5.期末基金资产净值	1,329,216,700.00	1,340

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
南方高端装备灵活配置混合A

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	-7.75%	1.42%	-1.81%	1.06%	-6.94%	0.37%

南方高端装备灵活配置混合C

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	-7.92%	1.43%	-1.81%	1.06%	-6.11%	0.37%

注:南方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。
3.2.2 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的比较
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“南方高元”。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	78,394.12	2,367.05
2.本期利润	164,268.08	5,711.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0140	0.0140
4.期末基金份额净值	12,216,621.17	466,433.69
5.期末基金资产净值	1,063,139.63	1,054

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
南方高元A

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.42%	0.08%	0.34%	0.14%	1.08%	-0.06%

南方高元C

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.25%	0.07%	0.34%	0.14%	0.98%	-0.07%

注:南方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。
3.2.2 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的比较
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“南方高元”。

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时间	证券从业年限	说明
廖晓	本基金基金经理	2017年8月10日至今	10年	女,中国人民大学金融学硕士,具有基金从业资格,曾任招商证券高级研究员,2012年10月至2015年11月,任招商证券高级研究员,2015年11月至2016年12月,任招商证券高级研究员,2016年12月至2017年7月,任招商证券高级研究员,2017年7月至今,任南方基金基金经理,2018年3月至今,任南方基金基金经理。

注:1.本基金基金经理的任职日期为公募基金合同生效日,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募基金相关决议作出决定的公告(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。
3.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约定。
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,公平对待旗下基金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
本报告期内,本基金不存在异常交易行为。本报告期内本基金管理人管理的所有的投资组合与交易对手开收盘价间同日交易成交较少的单边交易金额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购后被动调仓所致。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
三季度,国内与国外形势都面临一定压力,国内经济增速放缓,尤其消费增速

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	1,161,436,167.23	89.60
2	其中:股票	1,161,436,167.23	89.60
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	10,044,000.00	0.77
5	其中:债券	10,044,000.00	0.77
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买入返售金融资产	-	-
10	其他资产	1,296,211,519.00	100.00
11	合计	2,457,647,686.23	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	-	-
C	制造业	889,276,363.83	67.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	19,900,489.51	1.56
G	信息、计算机、软件和信息技术服务业	14,241,930.00	1.11
H	金融业	-	-
I	房地产业	-	-
J	批发和零售业	-	-
K	住宿和餐饮业	50,698,647.2	3.96
L	租赁和商务服务业	51,605,731.77	3.98
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育、体育和娱乐业	-	-
P	医药制造业	-	-
Q	卫生和社会工作	40,200,000.00	3.14
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	其他	-	-
合计		1,161,436,167.23	90.46

5.3 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	300223	华光光电	9,600,007	100,220,000.00	7.91
2	002276	新北洋	5,000,071	88,861,000.00	6.91
3	002688	大族激光	2,000,021	84,740,000.00	6.62
4	002688	兆驰股份	900,033	79,869,000.00	6.20
5	002587	金亚科技	3,199,996	64,140,000.00	4.22
6	300036	超图软件	2,400,000	50,000,000.00	3.14
7	603027	分众传媒	5,999,967	61,069,300.00	4.18
8	600525	华友股份	7,200,000	65,472,000.00	3.96
9	600486	扬农化工	1,000,000	46,280,000.00	3.61
10	600300	万华化学	1,060,000	46,018,200.00	3.55

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

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	180299	汇博股份	300,000	30,051,000.00	9.30
2	113617	曙光软件	1,740	100,651.80	0.06

5.9 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内,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,基金管理人未存在申购、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.《南方高增长混合型证券投资基金基金合同》;
2.《南方高增长混合型证券投资基金托管协议》;
3.南方高增长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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-92,497,349.46	-
2.本期利润	-130,096,899.20	-
3.加权平均基金份额本期利润	-0.8170	-
4.期末基金份额净值	1,289,282,284.00	-
5.期末基金资产净值	1,063,139.63	-

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
南方高元A

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	-9.24%	1.61%	-0.78%	1.08%	-8.54%	0.47%

南方高元C

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	-9.34%	1.62%	-0.78%	1.08%	-8.59%	0.47%

注:南方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。
3.2.2 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的比较
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“南方高元”。

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时间	证券从业年限	说明
廖晓	本基金基金经理	2017年12月27日至今	12年	男,中国人民大学经济学学士,具有基金从业资格,2006年4月加入南方基金,曾任招商证券高级研究员,2012年10月至2015年11月,任招商证券高级研究员,2015年11月至2017年7月,任招商证券高级研究员,2017年7月至今,任南方基金基金经理,2018年3月至今,任南方基金基金经理。

注:1.本基金基金经理的任职日期为公募基金合同生效日,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募基金相关决议作出决定的公告(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。
3.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约定。
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,公平对待旗下基金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
本报告期内,本基金不存在异常交易行为。本报告期内本基金管理人管理的所有的投资组合与交易对手开收盘价间同日交易成交较少的单边交易金额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购后被动调仓所致。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
三季度,国内与国外形势都面临一定压力,国内经济增速放缓,尤其消费增速

创历史新高,代表性的汽车消费有较大程度下滑,显示出居民在较高的杠杆水平下购买力受到抑制。国内主要中美贸易摩擦升温,美国政府在本季度不断加大对美国加征关税,并在其他方面对中国投资进行阻碍,影响了国内市场的风险偏好。双重重压下,国内权益市场整体疲弱,除了石化、金融等板块外,大部分板块呈现下跌趋势。报告期内,本基金仓位上保持较低仓位,仓位控制得当,资产组合中,通信行业行业龙头的配置。同时考虑到石化行业的资本开支提前回补,是为数不多的景气度还在上升的行业,我们增加了石化能源上游设备的配置。
截至报告期末,本基金A份额净值为0.9834元,报告期内,份额净值增长率为-9.24%,同期业绩比较基准增长率为-0.78%。
4.6 报告期内本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基金资产净值低于五千万元的情况。

南方高元债券型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

