

南方利淘灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票投资	68,548,034.47	57.57
2	定向资产管理	68,548,034.47	57.57
3	债券投资	40,496,100.00	33.71
4	货币市场基金	40,496,100.00	33.71
5	应收利息	188,536,881.00	15.68
6	其他资产	28,154,000.00	2.34
7	预付款项(可退利息)	846,972.61	0.00
8	其他	228,346,488.00	19.08
9	合计	337,368,445.48	28.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物、医药	174,100,000.00	14.12
B	制造业	174,100,000.00	14.12
C	信息技术	20,091,710.28	1.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	143,566,600.00	11.88
E	建筑业	2,429,716.20	0.02
F	农林牧渔	7,000,766.66	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	5,369,029.01	0.04
H	房地产业	—	—
I	医药生物、医药和制造业	30,330,300.00	2.50
J	食品饮料	—	—
K	有色金属	—	—
L	家用电器	—	—
M	教育、文化、娱乐、传媒	—	—
N	计算机、电子及通信设备	—	—
O	国防军工	—	—
P	医药	—	—
Q	其他	—	—
R	其他	—	—
S	合计	45,947,034.47	3.81

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	601928	中国人寿	30,210,439	3,210,439.00	2.67
2	601989	南钢股份	707,253	5,435,375.00	4.52
3	600844	华谊兄弟	300,000	2,862,000.00	2.38
4	600111	包装工业	376,270	3,761,270.00	3.12
5	600141	兴发集团	105,400	2,709,400.00	2.25
6	600027	华鲁恒升	330,000	2,540,300.00	2.11
7	600308	华泰证券	382,262	2,497,491.00	2.06
8	600370	中国软件	233,233	2,408,417.00	2.00
9	600080	上海贝岭	333,333	2,025,726.50	1.68
10	600029	保利地产	3,300,000	2,180,000.00	1.81

5.4 报告期末按品种分类的股票投资组合

代码	品种名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	债券、股票、货币	—	—
B	可转债	—	—
C	权证	—	—
D	股指期货	—	—
E	期权	—	—
F	定向资产管理	—	—
G	其他	—	—
H	合计	—	—

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	601928	中国人寿	30,210,439	3,210,439.00	2.67
2	601989	南钢股份	707,253	5,435,375.00	4.52
3	600844	华谊兄弟	300,000	2,862,000.00	2.38
4	600111	包装工业	376,270	3,761,270.00	3.12
5	600141	兴发集团	105,400	2,709,400.00	2.25
6	600027	华鲁恒升	330,000	2,540,300.00	2.11
7	600308	华泰证券	382,262	2,497,491.00	2.06
8	600370	中国软件	233,233	2,408,417.00	2.00
9	600080	上海贝岭	333,333	2,025,726.50	1.68
10	600029	保利地产	3,300,000	2,180,000.00	1.81

5.4 报告期末按品种分类的股票投资组合

代码	品种名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	债券、股票、货币	—	—
B	可转债	—	—
C	权证	—	—
D	股指期货	—	—
E	期权	—	—
F	定向资产管理	—	—
G	其他	—	—
H	合计	—	—

南方利鑫灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票投资	47,401,623.38	38.37
2	定向资产管理	47,401,623.38	38.37
3	债券投资	492,388,436.00	39.62
4	货币市场基金	492,388,436.00	39.62
5	其他资产	—	—
6	应收利息	—	—
7	预付款项(可退利息)	—	—
8	其他	—	—
9	合计	1,014,200,519.76	80.67

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物、医药	326,500,000.00	25.61
B	制造业	27,784,269.77	2.18
C	信息技术	89,470,454.00	7.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	184,866,600.00	14.64
E	建筑业	2,143,300.00	0.02
F	农林牧渔	8,016,482.62	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	6,707,444.67	0.05
H	房地产业	—	—
I	医药生物、医药和制造业	15,500,000.00	1.22
J	食品饮料	—	—
K	有色金属	—	—
L	家用电器	—	—
M	教育、文化、娱乐、传媒	—	—
N	计算机、电子及通信设备	—	—
O	国防军工	—	—
P	医药	—	—
Q	其他	—	—
R	其他	—	—
S	合计	47,401,623.38	3.73

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	601928	中国人寿	410,500	3,737,400.00	3.00
2	600199	金隅股份	790,411	6,413,344.10	5.16
3	600044	华谊兄弟	299,000	2,749,220.00	2.21
4	600111	包装工业	376,270	3,761,270.00	3.01
5	600141	兴发集团	105,400	2,709,400.00	2.20
6	600027	华鲁恒升	330,000	2,643,303.00	2.14
7	600308	华泰证券	330,000	2,540,300.00	2.04
8	600370	中国软件	233,233	2,408,417.00	1.94
9	600080	上海贝岭	333,333	2,025,726.50	1.63
10	600029	保利地产	3,300,000	2,180,000.00	1.75

5.4 报告期末按品种分类的股票投资组合

代码	品种名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	债券、股票、货币	—	—
B	可转债	—	—
C	权证	—	—
D	股指期货	—	—
E	期权	—	—
F	定向资产管理	—	—
G	其他	—	—
H	合计	—	—

南方利众灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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,后续较多的利好政策的预期值得期待。其次,信贷资产置换、资产证券化、定向增发、并购重组等投融资活动依然保持有较大规模,从资金面上看,以外资为首的资金仍在源源不断进入市场,有利于优质个股持续获得流动性支持。

4.3 公募基金业绩回顾
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。

4.4 公募基金业绩展望
展望四季度,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,后续较多的利好政策的预期值得期待。其次,信贷资产置换、资产证券化、定向增发、并购重组等投融资活动依然保持有较大规模,从资金面上看,以外资为首的资金仍在源源不断进入市场,有利于优质个股持续获得流动性支持。

4.3 公募基金业绩回顾
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。

4.4 公募基金业绩展望
展望四季度,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,后续较多的利好政策的预期值得期待。其次,信贷资产置换、资产证券化、定向增发、并购重组等投融资活动依然保持有较大规模,从资金面上看,以外资为首的资金仍在源源不断进入市场,有利于优质个股持续获得流动性支持。

4.3 公募基金业绩回顾
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。

4.4 公募基金业绩展望
展望四季度,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,后续较多的利好政策的预期值得期待。其次,信贷资产置换、资产证券化、定向增发、并购重组等投融资活动依然保持有较大规模,从资金面上看,以外资为首的资金仍在源源不断进入市场,有利于优质个股持续获得流动性支持。

4.3 公募基金业绩回顾
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。

4.4 公募基金业绩展望
展望四季度,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,后续较多的利好政策的预期值得期待。其次,信贷资产置换、资产证券化、定向增发、并购重组等投融资活动依然保持有较大规模,从资金面上看,以外资为首的资金仍在源源不断进入市场,有利于优质个股持续获得流动性支持。

4.3 公募基金业绩回顾
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。

4.4 公募基金业绩展望
展望四季度,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,后续较多的利好政策的预期值得期待。其次,信贷资产置换、资产证券化、定向增发、并购重组等投融资活动依然保持有较大规模,从资金面上看,以外资为首的资金仍在源源不断进入市场,有利于优质个股持续获得流动性支持。

4.3 公募基金业绩回顾
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。

4.4 公募基金业绩展望
展望四季度,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,后续较多的利好政策的预期值得期待。其次,信贷资产置换、资产证券化、定向增发、并购重组等投融资活动依然保持有较大规模,从资金面上看,以外资为首的资金仍在源源不断进入市场,有利于优质个股持续获得流动性支持。

4.3 公募基金业绩回顾
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。

4.4 公募基金业绩展望
展望四季度,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,后续较多的利好政策的预期值得期待。其次,信贷资产置换、资产证券化、定向增发、并购重组等投融资活动依然保持有较大规模,从资金面上看,以外资为首的资金仍在源源不断进入市场,有利于优质个股持续获得流动性支持。

4.3 公募基金业绩回顾
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。

4.4 公募基金业绩展望
展望四季度,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,后续较多的利好政策的预期值得期待。其次,信贷资产置换、资产证券化、定向增发、并购重组等投融资活动依然保持有较大规模,从资金面上看,以外资为首的资金仍在源源不断进入市场,有利于优质个股持续获得流动性支持。

4.3 公募基金业绩回顾
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。

4.4 公募基金业绩展望
展望四季度,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,后续较多的利好政策的预期值得期待。其次,信贷资产置换、资产证券化、定向增发、并购重组等投融资活动依然保持有较大规模,从资金面上看,以外资为首的资金仍在源源不断进入市场,有利于优质个股持续获得流动性支持。

4.3 公募基金业绩回顾
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金法》等法律法规,秉承客观、公正、专业、勤勉的原则,为基金份额持有人利益,积极参与并推动公募基金行业健康发展。

4.4 公募基金业绩展望
展望四季度,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

南方利淘灵活配置混合型证券投资基金

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	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票投资	68,548,034.47	57.57
2	定向资产管理	68,548,034.47	57.57
3	债券投资	40,496,100.00	33.71
4	货币市场基金	40,496,100.00	33.71
5	应收利息	188,536,881.00	15.68
6	其他资产	28,154,000.00	2.34
7	预付款项(可退利息)	846,972.61	0.00
8	其他	228,346,488.00	19.08
9	合计	337,368,445.48	28.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物、医药	174,100,000.00	14.12
B	制造业	174,100,000.00	14.12
C	信息技术	20,091,710.28	1.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	143,566,600.00	11.88
E	建筑业	2,429,716.20	0.02
F	农林牧渔	7,000,766.66	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	5,369,029.01	0.04
H	房地产业	—	—
I	医药生物、医药和制造业	30,330,300.00	2.50
J	食品饮料	—	—
K	有色金属	—	—
L	家用电器	—	—
M	教育、文化、娱乐、传媒	—	—
N	计算机、电子及通信设备	—	—
O	国防军工	—	—
P	医药	—	—
Q	其他	—	—
R	其他	—	—
S	合计	45,947,034.47	3.81

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	601928	中国人寿	30,210,439	3,210,439.00	2.67
2	601989	南钢股份	707,253	5,435,375.00	4.52
3	600844	华谊兄弟	300,000	2,862,000.00	2.38
4	600111	包装工业	376,270	3,761,270.00	3.12
5	600141	兴发集团	105,400	2,709,400.00	2.25
6	600027	华鲁恒升	330,000	2,540,300.00	2.11
7	600308	华泰证券	382,262	2,497,491.00	2.06
8	600370	中国软件	233,233	2,408,417.00	2.00
9	600080	上海贝岭	333,333	2,025,726.50	1.68
10	600029	保利地产	3,300,000	2,180,000.00	1.81

5.4 报告期末按品种分类的股票投资组合

代码	品种名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	债券、股票、货币	—	—
B	可转债	—	—
C	权证	—	—
D	股指期货	—	