南方融尚再融资主题精选灵活配置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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	南方融尚再融资主题精选灵活配置混合
基金主代码	005403
交易代码	005403
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年1月29日
报告期末基金份额总额	473,746,880.94份
投资目标	本基金为灵活配置混合型证券投资基金,主要投资于精选的再融资主题证券,在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上,通过"自上而下"的资产配置及动态调整策略,确定投资组合的投资范围和比例。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*35%+上证国债指数收益率*15%+中证可转换债券指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

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"南方融尚再融资"。

§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	315,858.20
2.本期利润	-2,031,501.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0041
4.期末基金资产净值	469,335,203.82
5.期末基金份额净值	0.9907

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;

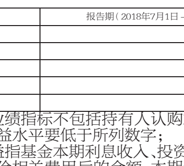
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-0.42%	0.28%	0.83%	0.69%	-1.25%	-0.41%

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1月29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		
孙鲁闽	本基金基金经理	2018年1月29日	-	15年	南开大学理学和经济学双学士、澳大利亚新南威尔士大学商学硕士,具有基金从业资格。曾任职于厦门国际银行福州分行,2003年4月加入南方基金,历任行业研究员、南方高增和南方隆元的基金经理助理、专户投资管理部总监助理、权益投资部副总监,现任权益投资部董事总经理;2007年12月至2010年10月,担任南方基金企业年金和专户的投资经理。2011年6月至2017年7月,任南方保本基金经理;2015年12月至2017年12月,任南方瑞利保本基金经理;2015年5月至2018年6月,任南方丰合保本基金经理;2010年12月至今,任南方避险基金经理;2015年4月至今,任南方利淘基金经理;2015年5月至今,任南方利鑫基金经理;2016年1月至今,任南方益和保本基金经理;2016年9月至今,任南方安泰混合基金经理;2016年11月至今,任南方安裕混合基金经理;2017年7月至今,任南方安睿混合基金经理;2017年12月至今,任南方瑞利混合基金经理;2018年1月至今,任南方融尚再融资基金经理;2018年6月至今,任南方新蓝筹混合、南方改革机遇、南方甄智混合基金经理。
陈乐	本基金基金经理	2018年1月29日	-	10年	北京大学金融学硕士,注册金融分析师(CFA),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;2016年2月至2017年12月,任南方避险、南方平衡配置(原:南方保本)、南方利淘、南方利鑫、南方丰合、南方益和、南方瑞利的基金经理助理;2016年10月至2017年12月,任南方安泰养老基金经理助理;2016年12月至2017年12月,任南方安裕养老基金经理助理;2017年8月至2017年12月,任南方安睿混合基金经理助理。2017年12月至今,任南方瑞利混合基金经理;2018年1月至今,任南方融尚再融资基金经理;2018年6月至今,任南方睿见混合基金经理。

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年三季度,中国经济各驱动因素均显现疲弱态势,市场面临的不确定性继续增加。国际局势微妙,中美贸易战持续加码,双方面临深刻的分歧。同时随着地产数据回落,具有后周期属性的消费增速也出现下行。三季度权益市场震荡下行。上证综指收于2821,较上季度末下跌0.9%;创业板指收于1411,较上季度下跌12.2%。

三季度本基金股票仓位略有提升。在风格上本基金的核心股票仓位投向低估值、高分红、具有安全边际的价值股,同时积极寻找具有竞争优势的白马股投资机会。固定收益投资上,本基金的可转债投资以债性转债为主,同时配置了部分一年内利率债提升资金效率。

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0.9907元,报告期内,份额净值增长率为-0.42%,同期业绩基准增长率为0.83%。

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	92,623,271.75	19.62
	其中:股票	92,623,271.75	19.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	349,588,871.43	74.07
	其中:债券	349,588,871.43	74.07
	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	25,919,681.44	5.49
8	其他资产	3,847,855.17	0.82
9	合计	471,979,679.79	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	55,145,822.15	11.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	692,550.00	0.15
F	批发和零售业	8,622,063.80	1.84
G	交通运输、仓储和邮政业	3,127,912.80	0.67
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	22,907,423.00	4.88
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,127,500.00	0.45
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	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	92,623,271.75	19.73

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	601009	南京银行	1,000,300	7,652,295.00	1.63
2	601818	光大银行	1,700,800	6,650,128.00	1.42
3	601166	兴业银行	320,000	5,104,000.00	1.09
4	000786	北新建材	260,100	4,315,059.00	0.92
5	600056	中国医药	240,000	4,036,800.00	0.86
6	600519	贵州茅台	5,500	4,015,000.00	0.86
7	002597	金禾实业	230,000	3,891,600.00	0.83
8	601966	玲珑轮胎	230,000	3,611,000.00	0.77
9	601288	农业银行	900,000	3,501,000.00	0.75
10	002078	太阳纸业	440,000	3,366,000.00	0.72

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	105,851,618.00	22.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,190,000.00	14.96
	其中:政策性金融债	70,190,000.00	14.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	173,547,253.43	36.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	349,588,871.43	74.49

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	019537	16国债09	359,800	35,947,618.00	7.66
2	018005	国开1701	300,000	30,180,000.00	6.43
3	019592	18国债10	300,000	30,030,000.00	6.40
4	160208	16国开08	300,000	29,970,000.00	6.39
5	132011	17浙报EB	293,210	26,383,035.80	5.62

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。

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。

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	60,475.79
2	应收证券清算款	471,459.68
3	应收股利	-
4	应收利息	3,314,350.67
5	应收申购款	1,569.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,847,855.17

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	113019	玲珑转债	4,327,946.40	0.92
2	127006	敖东转债	780,025.20	0.17
3	110043	无锡转债	687,330.00	0.15
4	127005	长证转债	592,844.00	0.13
5	113015	隆基转债	486,900.00	0.10
6	128032	双环转债	284,760.00	0.06
7	128027	崇达转债	119.43	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	534,416,204.63
报告期期间基金总申购份额	467,616.53
减:报告期期间基金总赎回份额	61,136,940.22
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	473,746,880.94

§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、《南方融尚再融资主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

2、《南方融尚再融资主题精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

3、南方融尚再融资主题精选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

南方瑞利灵活配置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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	南方瑞利灵活配置混合
基金主代码	002220
交易代码	002220
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月30日
报告期末基金份额总额	139,095,134.48份
投资目标	在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下,通过专业化研究分析,力争实现基金资产的长期稳定增值。
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×60%+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水平低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

注:1. 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"南方瑞利"。

2. 本基金转型日期为2017年12月30日,该日起原南方瑞利保本混合型证券投资基金正式转型为南方瑞利灵活配置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	427,628.65
2.本期利润	-4,211,759.37
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0289
4.期末基金资产净值	141,968,612.81
5.期末基金份额净值	1.0207

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损益。

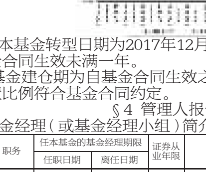
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-2.62%	0.97%	-0.75%	0.82%	-1.87%	0.15%

3.2.2 自基金转型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:1. 本基金转型日期为2017年12月30日,截止报告期末,本基金转型后基金合同生效未满一年。

2. 本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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		
孙鲁闽	本基金基金经理	2017年12月30日	-	15年	南开大学理学和经济学双学士、澳大利亚新南威尔士大学商学硕士,具有基金从业资格。曾任职于厦门国际银行福州分行,2003年4月加入南方基金,历任行业研究员、南方高增和南方隆元的基金经理助理、专户投资管理部总监助理、权益投资部副总监,现任权益投资部董事总经理;2007年12月至2010年10月,担任南方基金企业年金和专户的投资经理。2011年6月至2017年7月,任南方保本基金经理;2015年12月至2017年12月,任南方瑞利保本基金经理;2015年5月至2018年6月,任南方丰合保本基金经理;2010年12月至今,任南方避险基金经理;2015年4月至今,任南方利淘基金经理;2015年5月至今,任南方利鑫基金经理;2016年1月至今,任南方益和保本基金经理;2016年9月至今,任南方安泰混合基金经理;2016年11月至今,任南方安裕混合基金经理;2017年7月至今,任南方安睿混合基金经理;2017年12月至今,任南方瑞利混合基金经理;2018年1月至今,任南方融尚再融资基金经理;2018年6月至今,任南方新蓝筹混合、南方改革机遇、南方甄智混合基金经理。
陈乐	本基金基金经理	2017年12月30日	-	10年	北京大学金融学硕士,注册金融分析师(CFA),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;2016年2月至2017年12月,任南方避险、南方平衡配置(原:南方保本)、南方利淘、南方利鑫、南方丰合、南方益和、南方瑞利的基金经理助理;2016年10月至2017年12月,任南方安泰养老基金经理助理;2016年12月至2017年12月,任南方安裕养老基金经理助理;2017年8月至2017年12月,任南方安睿混合基金经理助理。2017年12月至今,任南方瑞利混合基金经理;2018年1月至今,任南方融尚再融资基金经理;2018年6月至今,任南方睿见混合基金经理。

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年三季度,中国经济各驱动因素均显现疲弱态势,市场面临的不确定性继续增加。国际局势微妙,中美贸易战持续加码,双方面临深刻的分歧。同时随着地产数据回落,具有后周期属性的消费增速也出现下行。三季度权益市场震荡下行。上证综指收于2821,较上季度末下跌0.9%;创业板指收于1411,较上季度下跌12.2%。

三季度本基金股票仓位基本稳定。在风格上本基金的核心股票仓位投向低估值、高分红、具有安全边际的价值股,同时积极寻找具有竞争优势的白马股投资机会。

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1.0207元,报告期内,份额净值增长率为-2.62%,同期业绩基准增长率为-0.75%。

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	100,145,995.98	68.84
	其中:股票	100,145,995.98	68.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,276,061.40	23.56
	其中:债券	34,276,061.40	23.56
	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	7,000,000.00	4.81
	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	3,063,671.05	2.11
8	其他资产	997,041.91	0.69
9	合计	145,482,770.34	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	55,998,987.82	39.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	806,156.00	0.57
E	建筑业	2,355,245.91	1.66
F	批发和零售业	8,891,967.46	6.26
G	交通运输、仓储和邮政业	5,572,729.69	3.93
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	23,537,303.10	16.58
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,983,606.00	2.10
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	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	100,145,995.98	70.54

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	570,000	9,091,500.00	6.40
2	601009	南京银行	872,886	6,677,577.90	4.70
3	600519	贵州茅台	7,800	5,694,000.00	4.01
4	000786	北新建材	280,000	4,645,200.00	3.27
5	000651	格力电器	110,359	4,436,431.80	3.12
6	600176	中国巨石	400,140	4,245,485.40	2.99
7	600887	伊利股份	160,000	4,108,800.00	2.89
8	600511	国药股份	135,000	3,545,100.00	2.50
9	600056	中国医药	210,000	3,532,200.00	2.49
10	002511	中顺洁柔	420,265	3,467,186.25	2.44

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	10,024,000.00	7.06
	其中:政策性金融债	10,024,000.00	7.06
4	企业债券	22,380,000.00	15.76
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,872,061.40	1.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	34,276,061.40	24.14

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	180207	18国开07	100,000	10,024,000.00	7.06
2	136133	16国电01	100,000	9,981,000.00	7.03
3	136029	15华宝债	53,200	5,320,000.00	3.75
4	122295	13川投01	50,000	5,063,000.00	3.57
5	122686	12白药债	20,000	2,016,000.00	1.42

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。

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	28,586.48
2	应收证券清算款	319,715.55
3	应收股利	-
4	应收利息	648,738.89
5	应收申购款	0.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	997,041.91

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	123009	星源转债	921,881.00	0.65
2	113019	玲珑转债	275,330.40	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

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	155,530,246.29
报告期期间基金总申购份额	138,314.78
减:报告期期间基金总赎回份额	16,573,426.59
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	139,095,134.48

§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、《南方瑞利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

2、《南方瑞利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

3、南方瑞利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

南方瑞祥一年定期开放灵活配置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:中国工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。

基金托管人中国工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	南方瑞祥一年定开混合	
基金主代码	005810	
交易代码	005810	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年5月10日	
报告期末基金份额总额	1,956,712,438.95份	
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×50%+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×30%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,一般而言,其预期风险收益水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。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。	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方瑞祥一年混合A	南方瑞祥一年混合C
下属分级基金的交易代码	005810	005811
报告期末下属分级基金的份额总额	1,729,746,278.57份	226,966,160.38份

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"南方瑞祥"。

§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)	
	南方瑞祥一年混合A	南方瑞祥一年混合C
1.本期已实现收益	-26,221,993.71	-4,106,889.83
2.本期利润	-23,096,274.02	-3,700,796.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0134	-0.0163
4.期末基金资产净值	1,706,768,204.58	222,900,603.25
5.期末基金份额净值	0.9867	0.9821

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、本基金合同生效日为2018年5月10日,至本报告期末未满一年。

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

南方瑞祥一年混合A

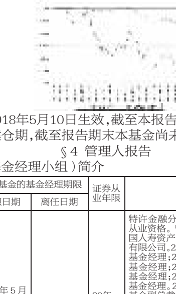
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.34%	0.21%	-0.98%	0.84%	-0.36%	-0.63%

南方瑞祥一年混合C

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	-1.63%	0.21%	-0.98%	0.84%	-0.65%	-0.63%

注:本基金合同生效日为2018年5月10日,至本报告期末未满一年。

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5月10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,截至报告期末本基金尚未完成建仓。

§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		
史博	本基金基金经理	2018年5月10日	-	20年	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。2011年2月至今,任南方绩优基金经理;2014年2月至今,任南方新优享基金经理;2015年9月至今,任南方消费活力基金经理;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、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

报告期内,宏观经济数据出现走弱的迹象,管理人认为2018年整体宏观经济虽然具有较强的韧性,但受制于金融去杠杆和贸易战影响,宏观经济趋势走弱,短期进入阵痛期。值得欣喜的是国家对于经济结构调整的决心较强,随着国家鼓励发展新经济,挖掘经济增长新动能,我们认为未来在新经济领域将有更多的政策扶持,医药、计算机、传媒、5G、新能源汽车、消费等领域存在投资机会。此外,部分传统行业随着需求的回升和格局的好转亦存在较好的投资机会,例如公用事业、基建、有色、先进制造等。

报告期内本基金秉承优选行业和优选个股相结合的原则,依据宏观方面的判断,对于仓位和持仓结构进行调整,主要配置旅游、大消费、公用事业、医药、食品饮料、农药等行业,个股层面遵循自下而上的选股原则,优选增速和估值相对匹配,持续成长的公司,以及行业格局改善,盈利好转的龙头公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A份额净值为0.9867元,报告期内,份额净值增长率为-1.34%,同期业绩基准增长率为-0.98%;本基金C份额净值为0.9821元,报告期内,份额净值增长率为-1.63%,同期业绩基准增长率为-0.98%。

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	356,831,801.14	18.46
	其中:股票	356,831,801.14	18.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,286,171,000.00	66.52
	其中:债券	1,286,171,000.00	66.52
	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	220,000,000.00	11.38
	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	47,217,978.52	2.44
8	其他资产	23,255,988.22	1.20
9	合计	1,933,476,767.88	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	140,871,849.36	7.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,937,724.00	1.66
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	16,658,710.65	0.86
J	金融业	328.86	0.00
K	房地产业	13,501,080.00	0.70
L	租赁和商务服务业	26,745,464.00	1.39
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	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	229,715,156.87	11.90

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
公用事业	104,430,565.32	5.41
非必需消费	8,234,941.68	0.43
科技	8,063,369.03	0.42
医疗保健	6,387,768.24	0.33
合计	127,116,644.27	6.59

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	00902	华能国际电力股份有限公司	21,364,000	96,816,146.78	5.02
2	600519	贵州茅台	79,361	57,933,530.00	3.00
3	000661	长春高新	166,164	39,380,868.00	2.04
4	600900	长江电力	1,949,800	31,937,724.00	1.66
5	601888	中国国旅	393,200	26,745,464.00	1.39
6	002258	利尔化学	1,126,734	21,498,084.72	1.11
7	300571	平治信息	291,491	16,658,710.65	0.86
8	000002	万 科A	555,600	13,501,080.00	0.70
9	000629	攀钢钒钛	2,742,600	12,149,718.00	0.63
10	02678	天虹纺织集团有限公司	798,500	8,234,941.68	0.43

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	221,931,000.00	11.50
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	1,064,240,000.00	55.15
9	其他	-	-
10	合计	1,286,171,000.00	66.65

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	111814104	18江苏银行CD104	2,000,000	194,420,000.00	10.08
2	111812130	18北京银行CD130	1,000,000	97,230,000.00	5.04
3	111892516	18南京银行CD031	1,000,000	95,810,000.00	4.97
4	011801161	18陕煤化SCP010	900,000	90,522,000.00	4.69
5	041800135	18兖矿CP002	800,000	80,920,000.00	4.19

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

本基金在进行国债期货投资时,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、交易活跃的国债期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债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国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债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。

5.10.2 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平安银行CD178(证券代码111811178)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平安银行CD178(证券代码111811178)

2018年3月,平安银行因违反清算管理等多项规定被央行罚款1334.42万元。

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	114,401.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	49,318.87
4	应收利息	23,092,267.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,255,988.22

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

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	南方瑞祥一年混合A	南方瑞祥一年混合C
报告期期初基金份额总额	1,729,746,278.57	226,966,160.38
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	-	-
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	1,729,746,278.57	226,966,160.38

§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

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《南方瑞祥一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

2、《南方瑞祥一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

3、南方瑞祥一年定期开放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