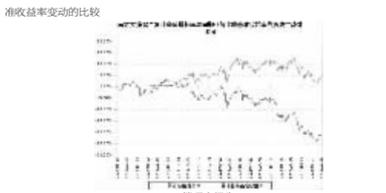


南方文旅休闲灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告



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
姓名	职务	任职日期	离任日期	
陈秋洁	本基金基金经理	2017年5月30日	-	10年

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 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明
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,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作符合法律法规,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。本报告期内基金经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5%的交易次数为4次,是由于投资组合承接投资者申购赎回被动增减仓位以及投资组合的投资策略调整所致。

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析
2018年前三季度,随着部分经济数据逐月转弱和中美贸易摩擦不断加大,各大指数持续下跌,市场悲观情绪加剧。从目前的情况来看来自内外的压力,应作为系统性风险向中期投资过程中。文旅休闲相关行业发展速度仍较快,影视、餐饮、酒店、休闲游、出入境游等相关行业都有不错的发展。用户教育消费升级带来的景气度、付费意愿、付费阅读等各环节不断有模式创新,并带动产业链健康发展。来自内外的市场压力不断加大过程中,我们看国内政策已经有所转向,从大的政策方向看,去杠杆的过程有所放缓,流动性相对宽松,基建项目审批已与开工有所加快。同时,政策在鼓励创新,优化股权结构,扩大内需进一步加码。持续的创新驱动是提升国家长

期比较优势和企业在生产要素中的重要因素,具有持续创新能力的行业与企业仍然是我们关注的重点。在经济周期和外部贸易摩擦加剧下,内需对于经济的拉动显得更为重要,作为世界人口大国,我们内在的消费潜力还有很大的挖掘空间,未来消费升级与消费升级仍将继续发出更多的新活力。
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1.0403元,报告期内,份额净值增长率为-4.93%,同期业绩基准增长率为-10.24%。
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。

5.1 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	25,795,561.48	44.71
2	固定收益	26,789,561.48	44.71
3	固定收益投资	3,716,126.40	6.44
3.1	其中:债券	3,716,126.40	6.44
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	38,023,794.18	63.50
10	其他资产	147,500.07	0.26
11	合计	97,672,950.13	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

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	276,218.00	0.80
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,777,826.32	16.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,064,169.00	3.64
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	3,194,002.20	5.66
J	金融业	561,700.00	0.98
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,487,906.96	15.03
M	科学研究和技术服务业	584,846.00	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	卫生和社会工作	692,988.00	1.23
P	教育	565,900.00	0.98
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
合计		25,795,561.48	44.67

南方稳健成长贰号证券投资基金

2018年第三季度报告

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
姓名	职务	任职日期	离任日期	
邱明	本基金基金经理	2012年11月23日	-	17年

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 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明
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,基金运作符合法律法规,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。本报告期内基金经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,是由于投资组合承接投资者申购赎回被动增减仓位以及投资组合的投资策略调整所致。

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析
2018年中国资本市场波动明显加大,市场风格反复多变,各指数都进入震荡下行模式,一季度创业板明显优于主板,进入二季度以来中小市值个股普遍暴跌,创业板大幅回落,蓝筹股回调较大。三季度延续二季度走势,主板和蓝筹表现偏弱,中小市值个股继续大幅下跌。宏观经济增长,国内经济虽然预期向好,但数据依然疲弱,而市场所关注的焦点则集中到了中美贸易争端,目前来看该争端有所升级且未取得阶段性成果,预期持续对股市产生压制压力,本基金今年以来仓位持续下行,在季度末有所增加,但总体仓位水平低于本基金历史平均水平。在新能、半导体、工业互联网板块方面做操作,降低了通讯、周期、家电、白酒的配置,增加了医药配置,目前本基金主要的投资方向依然集中在白酒、银行、家电。本基金将继续采取自下而上的选股策略,以价值投资理念,争取获得较好的绝对收益。

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0.4280元,报告期内,份额净值增长率为-4.50%,同期业绩基准增长率为-0.48%。
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。

5.1 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	1,028,083,819.14	64.88
2	固定收益	1,028,083,819.14	64.88
3	固定收益投资	382,946,718.00	23.93
3.1	其中:债券	382,946,718.00	23.93
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	130,000,000.00	8.13
7	银行存款和结算备付金合计	22,640,799.23	1.42
8	其他资产	26,410,007.37	1.65
9	合计	1,599,980,360.74	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

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	719,312,001.76	45.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,263.79	0.00
E	建筑业	28,244,550.29	1.74
F	批发和零售业	10,348.43	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	7,216.71	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	22,497,899.23	1.38
J	金融业	211,489,824.37	13.21
K	房地产业	769.06	0.00
L	租赁和商务服务业	44,002,140.44	2.76
M	科学研究和技术服务业	356.86	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,064.29	0.00
O	卫生和社会工作	-	-
P	教育	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	14,512,500.00	0.91
R	综合	-	-
合计		1,028,083,819.14	65.04

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1.026元,报告期内,份额净值增长率为1.28%,同期业绩基准增长率为0.46%。本基金份额净值为1.016元,报告期内,份额净值增长率为1.20%,同期业绩基准增长率为0.48%。
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。

5.1 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	-	-
2	固定收益	-	-
3	固定收益投资	2,570,614,185.34	92.33
3.1	其中:债券	2,370,568,185.34	85.63
4	资产支持证券	200,056,000.00	7.20
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	151,110,469.80	5.44
9	合计	2,778,281,792.50	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	4,970.60	0.00
2	金融债券	987,900,029.00	40.07
3	其中:政策性金融债	181,344,400.00	40.07
4	企业债券	849,022,631.94	41.31
5	企业短期融资券	131,307,000.00	6.39
6	中期票据	402,263,500.00	16.87
7	可转债(可交换债)	-	-
8	银行存款	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,370,568,185.34	100.00

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五名债券投资明细

6.2.2 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。
6.3 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	000227	分众传媒	539,398	4,500,289.96	8.13
2	601888	中国国航	57,300	3,897,546.00	6.90
3	600519	贵州茅台	3,400	2,482,000.00	4.40
4	300413	芒果超媒	60,300	2,294,157.00	3.94
5	002410	广联达	75,000	2,024,568.00	3.69
6	600988	鲁通股份	46,600	1,360,704.00	2.41
7	000661	长春高新	3,390	900,600.00	1.60
8	300085	艾德生物	14,200	831,602.00	1.48
9	300047	泰格医药	12,900	662,980.00	1.23
10	600104	上汽集团	10,600	652,288.00	1.16

6.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	3,692,029.00	6.64
3.1	其中:政策性金融债	3,692,029.00	6.64
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)	24,106.40	0.04
8	银行存款	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,716,126.40	6.58

6.5 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

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	101906	国开1701	38,700	3,692,029.00	6.64
2	118117	博时转债	220	24,106.40	0.04

6.6 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	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000006	博时1701	38,700	3,692,029.00	6.64
2	118117	博时转债	220	24,106.40	0.04

6.7 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贵金属投资明细

序号	代码	名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000022	分众传媒	539,398	4,500,289.96	8.13
2	601888	中国国航	57,300	3,897,546.00	6.90
3	600519	贵州茅台	3,400	2,482,000.00	4.40
4	300413	芒果超媒	60,300	2,294,157.00	3.94
5	002410	广联达	75,000	2,024,568.00	3.69
6	600988	鲁通股份	46,600	1,360,704.00	2.41
7	000661	长春高新	3,390	900,600.00	1.60
8	300085	艾德生物	14,200	831,602.00	1.48
9	300047	泰格医药	12,900	662,980.00	1.23
10	600104	上汽集团	10,600	652,288.00	1.16

6.8 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

序号	代码	名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000022	分众传媒	539,398	4,500,289.96	8.13
2	601888	中国国航	57,300	3,897,546.00	6.90
3	600519	贵州茅台	3,400	2,482,000.00	4.40
4	300413	芒果超媒	60,300	2,294,157.00	3.94
5	002410	广联达	75,000	2,024,568.00	3.69
6	600988	鲁通股份	46,600	1,360,704.00	2.41
7	000661	长春高新	3,390	900,600.00	1.60
8	300085	艾德生物	14,200	831,602.00	1.48
9	300047	泰格医药	12,900	662,980.00	1.23
10	600104	上汽集团	10,600	652,288.00	1.16

6.9 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	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000006	博时1701	38,700	3,692,029.00	6.64
2	118117	博时转债	220	24,106.40	0.04

6.10 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

序号	代码	名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000022	分众传媒	539,398	4,500,289.96	8.13
2	601888	中国国航	57,300	3,897,546.00	6.90
3	600519	贵州茅台	3,400	2,482,000.00	4.40
4	300413	芒果超媒	60,300	2,294,157.00	3.94
5	002410	广联达	75,000	2,024,568.00	3.69
6	600988	鲁通股份	46,600	1,360,704.00	2.41
7	000661	长春高新	3,390	900,600.00	1.60
8	300085	艾德生物	14,200	831,602.00	1.48
9	300047	泰格医药	12,900	662,980.00	1.23
1					