

南方利鑫灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

截至报告期末,本基金A份额净值为1.144元,报告期内,份额净值增长率为-0.69%,同期业绩基准增长率为1.03%;本基金C份额净值为1.144元,报告期内,份额净值增长率为-0.61%,同期业绩基准增长率为1.09%。
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	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,002,762.02	11.46
2	固定收益投资	62,002,762.02	11.46
3	权益投资	62,002,762.02	11.46
4	其他资产	62,002,762.02	11.46

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

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	111809367	18浦发银行CD367	400,000	40,000,000.00	7.42
2	111809376	18浦发银行CD376	500,000	47,750,000.00	8.85
3	111809377	18浦发银行CD377	400,000	40,000,000.00	7.42
4	130002	13国债02	480,000	39,740,000.00	7.35
5	111809381	18浦发银行CD381	400,000	39,750,000.00	7.35

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	资产代码	资产名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111809367	18浦发银行CD367	400,000	40,000,000.00	7.42
2	111809376	18浦发银行CD376	500,000	47,750,000.00	8.85
3	111809377	18浦发银行CD377	400,000	40,000,000.00	7.42
4	130002	13国债02	480,000	39,740,000.00	7.35
5	111809381	18浦发银行CD381	400,000	39,750,000.00	7.35

5.7 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	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130001	13国债01	384,000.00	38,400,000.00	7.14
2	130002	13国债02	480,000.00	39,740,000.00	7.35
3	130003	13国债03	480,000.00	39,740,000.00	7.35
4	130004	13国债04	480,000.00	39,740,000.00	7.35
5	130005	13国债05	480,000.00	39,740,000.00	7.35

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

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130001	13国债01	384,000.00	38,400,000.00	7.14
2	130002	13国债02	480,000.00	39,740,000.00	7.35
3	130003	13国债03	480,000.00	39,740,000.00	7.35
4	130004	13国债04	480,000.00	39,740,000.00	7.35
5	130005	13国债05	480,000.00	39,740,000.00	7.35

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130001	13国债01	384,000.00	38,400,000.00	7.14
2	130002	13国债02	480,000.00	39,740,000.00	7.35
3	130003	13国债03	480,000.00	39,740,000.00	7.35
4	130004	13国债04	480,000.00	39,740,000.00	7.35
5	130005	13国债05	480,000.00	39,740,000.00	7.35

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130001	13国债01	384,000.00	38,400,000.00	7.14
2	130002	13国债02	480,000.00	39,740,000.00	7.35
3	130003	13国债03	480,000.00	39,740,000.00	7.35
4	130004	13国债04	480,000.00	39,740,000.00	7.35
5	130005	13国债05	480,000.00	39,740,000.00	7.35

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

序号	期权代码	期权名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130001	13国债01	384,000.00	38,400,000.00	7.14
2	130002	13国债02	480,000.00	39,740,000.00	7.35
3	130003	13国债03	480,000.00	39,740,000.00	7.35
4	130004	13国债04	480,000.00	39,740,000.00	7.35
5	130005	13国债05	480,000.00	39,740,000.00	7.35

5.12 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	医药生物	62,002,762.02	11.46
2	信息技术	62,002,762.02	11.46
3	金融地产	62,002,762.02	11.46
4	其他行业	62,002,762.02	11.46

5.13 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	001301	浦发银行	600,000	6,000,000.00	1.11
2	001302	浦发银行	600,000	6,000,000.00	1.11
3	001303	浦发银行	600,000	6,000,000.00	1.11
4	001304	浦发银行	600,000	6,000,000.00	1.11
5	001305	浦发银行	600,000	6,000,000.00	1.11

5.14 报告期末按品种分类的债券投资组合

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	111809367	18浦发银行CD367	400,000	40,000,000.00	7.42
2	111809376	18浦发银行CD376	500,000	47,750,000.00	8.85
3	111809377	18浦发银行CD377	400,000	40,000,000.00	7.42
4	130002	13国债02	480,000	39,740,000.00	7.35
5	111809381	18浦发银行CD381	400,000	39,750,000.00	7.35

5.15 报告期末按品种分类的债券投资组合

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	111809367	18浦发银行CD367	400,000	40,000,000.00	7.42
2	111809376	18浦发银行CD376	500,000	47,750,000.00	8.85
3	111809377	18浦发银行CD377	400,000	40,000,000.00	7.42
4	130002	13国债02	480,000	39,740,000.00	7.35
5	111809381	18浦发银行CD381	400,000	39,750,000.00	7.35

5.16 报告期末按品种分类的债券投资组合

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	111809367	18浦发银行CD367	400,000	40,000,000.00	7.42
2	111809376	18浦发银行CD376	500,000	47,750,000.00	8.85
3	111809377	18浦发银行CD377	400,000	40,000,000.00	7.42
4	130002	13国债02	480,000	39,740,000.00	7.35
5	111809381	18浦发银行CD381	400,000	39,750,000.00	7.35

5.17 报告期末按品种分类的债券投资组合

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	111809367	18浦发银行CD367	400,000	40,000,000.00	7.42
2	111809376	18浦发银行CD376	500,000	47,750,000.00	8.85
3	111809377	18浦发银行CD377	400,000	40,000,000.00	7.42
4	130002	13国债02	480,000	39,740,000.00	7.35
5	111809381	18浦发银行CD381	400,000	39,750,000.00	7.35

5.18 报告期末按品种分类的债券投资组合

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	111809367	18浦发银行CD367	400,000	40,000,000.00	7.42
2	111809376	18浦发银行CD376	500,000	47,750,000.00	8.85
3	111809377	18浦发银行CD377	400,000	40,000,000.00	7.42
4	130002	13国债02	480,000	39,740,000.00	7.35
5	111809381	18浦发银行CD381	400,000	39,750,000.00	7.35

5.19 报告期末按品种分类的债券投资组合

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	111809367	18浦发银行CD367	400,000	40,000,000.00	7.42
2	111809376	18浦发银行CD376	500,000	47,750,000.00	8.85
3	111809377	18浦发银行CD377	400,000	40,000,000.00	7.42
4	130002	13国债02	480,000	39,740,000.00	7.35
5	111809381	18浦发银行CD381	400,000	39,750,000.00	7.35

5.20 报告期末按品种分类的债券投资组合

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	111809367	18浦发银行CD367	400,000	40,000,000.00	7.42
2	111809376	18浦发银行CD376	500,000	47,750,000.00	8.85
3	111809377	18浦发银行CD377	400,000	40,000,000.00	7.42
4	130002	13国债02	480,000	39,740,000.00	7.35
5	111809381	18浦发银行CD381	400,000	39,750,000.00	7.35

5.21 报告期末按品种分类的债券投资组合

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	111809367	18浦发银行CD367	400,000	40,000,000.00	7.42
2	111809376	18浦发银行CD376	500,000	47,750,000.00	8.85
3	111809377	18浦发银行CD377	400,000	40,000,000.00	7.42
4	130002	13国债02	480,000	39,740,000.00	7.35
5	111809381	18浦发银行CD381	400,000	39,750,000.00	7.35

5.22 报告期末按品种分类的债券投资组合

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	111809367	18浦发银行CD367	400,000	40,000,000.00	7.42
2	111809376	18浦发银行CD376	500,000	47,750,000.00	8.85
3	111809377	18浦发银行CD377	400,000	40,000,000.00	7.42
4	130002	13国债02	480,000	39,740,000.00	7.35
5	111809381	18浦发银行CD381	400,000	39,750,000.00	7.35

5.23 报告期末按品种分类的债券投资组合

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	111809367	18浦发银行CD367	400,000	40,000,000.00	7.42
2	111809376	18浦发银行CD376	500,000	47,750,000.00	8.85
3	111809377	18浦发银行CD377	400,000	40,000,000.00	7.42
4	130002	13国债02	480,000	39,740,000.00	7.35
5	111809381	18浦发银行CD381	400,000	39,750,000.00	7.35

5.24 报告期末按品种分类的债券投资组合

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	111809367	18浦发银行CD367	400,000	40,000,000.00	7.42
2	111809376	18浦发银行CD376	500,000	47,750,000.00	8.85
3	111809377	18浦发银行CD377	400,000	40,000,000.00	7.42
4	130002	13国债02	480,000	39,740,000.00	7.35
5	111809381	18浦发银行CD381	400,000	39,750,000.00	7.35

5.25 报告期末按品种分类的债券投资组合

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	111809367	18浦发银行CD367	400,000	40,000,000.00	7.42
2	111809376	18浦发银行CD376	500,000	47,750,000.00	8.85
3	111809377	18浦发银行CD377	400,000	40,000,000.00	7.42
4	130002	13国债02	480,000	39,740,000.00	7.35
5	111809381	18浦发银行CD381	400,000	39,750,000.00	7.35

5.26 报告期末按品种分类的债券投资组合

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	111809367	18浦发银行CD367	400,000	40,000,000.00	7.42
2	111809376	18浦发银行CD376	500,000	47,750,000.00	8.85
3	111809377	18浦发银行CD377	400,000	40,000,000.00	7.42
4	130002	13国债02	480,000	39,740,000.00	7.35
5	111809381	18浦发银行CD381	400,000	39,750,000.00	7.35

5.27 报告期末按品种分类的债券投资组合

采矿业		501,000.00	0.09
制造业		25,825,188.71	4.43
电力、热力、燃气及水生产和供应业		2,983,734.00	0.51
建筑业		1,987,271.04	0.32