

南方智造未来股票型证券投资基金

2018年第四季度报告

姓名	职务	在基金管理人任职期间	证券从业资格	说明
罗志光	基金经理	2017年01月13日	-	2017年01月13日

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为基金合同生效日，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的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵照行业协会《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
4.2.1 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，公平对待旗下管理的所有基金投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
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金额超过该

证券当日成交量的5%的交易次数为3次，是由于投资组合接受投资者申购后被动

增减仓位所致。

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析
2018年四季度，市场经历了巨大的波动，最终也录得了一个季度最大跌幅，沪深

300指数下跌12.45%，创业板也下跌11.39%。尽管市场比较惨淡，但期间市场出现了明

显的转机，首先，政策层面开始加码，去杠杆力度减弱，财政和货币政策都有望松

绑，减税政策力度也会有所加大；同时对于民营以及中小企业加大支持力度，保持经

济活力；中美贸易方面，贸易争端突破，直接谈判，贸易争端解决的可能性加大，大基

金仓位四季度有所降低，主要是减持了部分白酒和科技，同时大量减仓了设备股，行

业配置方向，白酒和银行依然保持基金重要头寸，同时也增加了电力、电设备股和基

建板块作为防御。同时在低位加仓科技板块，加大了半导体行业的配置。

4.5 报告期内基金的投资业绩和
截至报告期末，本基金份额净值为0.788元，报告期内，份额净值增长率为-13.79%，

同期业绩基准增长率为-11.06%。

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的情形，具体情况时间范围如下：

5.1 报告期末基金资产组合情况

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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境外股票投资组合

5.2.4 报告期末按行业分类的衍生品投资组合

5.2.5 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.6 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.7 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.2.8 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.9 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.10 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.11 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.12 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.13 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.14 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.15 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.16 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.17 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.18 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.19 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.20 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.21 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.22 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.23 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.24 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.25 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.26 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.27 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.28 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.29 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.30 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.31 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.32 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.33 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.34 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.35 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.36 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.37 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.38 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.39 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.40 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.41 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.42 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.43 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.44 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.45 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.46 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.47 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.48 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.49 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.50 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.51 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.52 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.53 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.54 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.55 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.56 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.57 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.58 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.59 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.60 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.61 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.62 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.63 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.64 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.65 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.66 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.67 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.68 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.69 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.70 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.71 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.72 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.73 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.74 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.75 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.76 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.77 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.78 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.79 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.80 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.81 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.82 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.83 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.84 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.85 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.86 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.87 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.88 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.89 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.90 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.91 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.92 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.93 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.94 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.95 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.96 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.97 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.98 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.99 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.100 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.101 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.102 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.103 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.104 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.105 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.106 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.107 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.108 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.109 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.110 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.111 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.112 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.113 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.114 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.115 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.116 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.117 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.118 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.119 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.120 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.121 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.122 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.123 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.124 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.125 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.126 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.127 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.128 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.129 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.130 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.131 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.132 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.133 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.134 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.135 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.136 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.137 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.138 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.139 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.140 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.141 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.142 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.143 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.144 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.145 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.146 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.147 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.148 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.149 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.150 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.151 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.152 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.153 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.154 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.155 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.156 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.157 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.158 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.159 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.160 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.161 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.162 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.163 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.164 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.165 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.166 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.167 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.168 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.169 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.170 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.171 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.172 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.173 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.174 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.175 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.176 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.177 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.178 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.179 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.180 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.181 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.182 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.183 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.184 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.185 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.186 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.187 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.188 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.189 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.190 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.191 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.192 报告期末按行业分类的衍生品投资

5.2.193 报告期末按行业分类的贵金属投资

5.2.194 报告期末按行业分类的资产支持证券投资

5.2.195 报告期末按行业分类的衍生品投资