

南华瑞盈混合型发起式证券投资基金

2018年第四季度报告

2018年4季度,A股市场在中美贸易战持续升级,对经济下行的悲观预期以及经济刺激政策力度不及预期等多方面因素的持续影响下,沪深300指数从3439点跌至3011点,跌幅达12.4%。尽管在组合配置上选取了周期的建筑、医药医疗、地产等行业,但产品净值仍下跌16.67%,未取得到期时的正收益。

期间2019年第一季度经济下行可能继续,经济刺激政策将逐步开始实施,对此我们将持续的跟踪,分行业配置,快进低估,逆周期行业,等待经济向好及刺激政策。

45 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末南华瑞盈混合型发起式基金份额净值为0.558357元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-16.67%,期间业绩比较基准收益率为-16.18%,期间业绩比较基准收益率为-1.11%。

46 报告期内基金份额持有人数或基金资产净值变动情况

无。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

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 000144 宝诚康乐 32,307 686,484.46 6.08

2 000461 东方银星 35,000 670,290.00 4.98

3 000308 中际集成 15,900 646,971.00 4.79

4 000036 聚光科技 29,000 646,234.00 4.09

5 600032 白云山 14,288 606,070.00 3.76

6 600049 伊利股份 37,000 436,230.00 3.23

7 601198 中国国建 37,200 404,364.00 3.09

8 000284 文科园林 38,900 404,015.20 3.09

9 000296 利源精科 62,000 399,890.00 2.96

10 001390 中国铁建 54,500 389,956.00 2.92

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农、林、牧、渔业 - -

2 采矿业 211,750.00 1.57

3 制造业 3,040,641.00 22.92

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 133,980.00 0.98

5 建筑业 1,039,003.00 0.77

6 批发和零售业 362,691.00 2.60

7 交通运输、仓储和邮政业 - -

8 信息传输、软件和信息技术服务业 1,978,035.44 14.06

9 金融业 533,100.00 3.96

10 房地产业 791,580.00 5.60

11 租赁和商务服务业 - -

12 科学研究、技术服务和地质勘查业 404,015.20 2.99

13 水、环境和公共设施管理业 - -

14 国际服务、修理和其他服务业 - -

15 教育 - -

16 文化、体育和娱乐业 685,404.46 5.08

17 综合 - -

18 合计 9,232,174.00 68.37

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农、林、牧、渔业 - -

2 采矿业 211,750.00 1.57

3 制造业 3,040,641.00 22.92

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 133,980.00 0.98

5 建筑业 1,039,003.00 0.77

6 批发和零售业 362,691.00 2.60

7 交通运输、仓储和邮政业 - -

8 信息传输、软件和信息技术服务业 1,978,035.44 14.06

9 金融业 533,100.00 3.96

10 房地产业 791,580.00 5.60

11 租赁和商务服务业 - -

12 科学研究、技术服务和地质勘查业 404,015.20 2.99

13 水、环境和公共设施管理业 - -

14 国际服务、修理和其他服务业 - -

15 教育 - -

16 文化、体育和娱乐业 685,404.46 5.08

17 综合 - -

18 合计 9,232,174.00 68.37

5.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农、林、牧、渔业 - -

2 采矿业 211,750.00 1.57

3 制造业 3,040,641.00 22.92

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 133,980.00 0.98

5 建筑业 1,039,003.00 0.77

6 批发和零售业 362,691.00 2.60

7 交通运输、仓储和邮政业 - -

8 信息传输、软件和信息技术服务业 1,978,035.44 14.06

9 金融业 533,100.00 3.96

10 房地产业 791,580.00 5.60

11 租赁和商务服务业 - -

12 科学研究、技术服务和地质勘查业 404,015.20 2.99

13 水、环境和公共设施管理业 - -

14 国际服务、修理和其他服务业 - -

15 教育 - -

16 文化、体育和娱乐业 685,404.46 5.08

17 综合 - -

18 合计 9,232,174.00 68.37

5.5 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农、林、牧、渔业 - -

2 采矿业 211,750.00 1.57

3 制造业 3,040,641.00 22.92

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 133,980.00 0.98

5 建筑业 1,039,003.00 0.77

6 批发和零售业 362,691.00 2.60

7 交通运输、仓储和邮政业 - -

8 信息传输、软件和信息技术服务业 1,978,035.44 14.06

9 金融业 533,100.00 3.96

10 房地产业 791,580.00 5.60

11 租赁和商务服务业 - -

12 科学研究、技术服务和地质勘查业 404,015.20 2.99

13 水、环境和公共设施管理业 - -

14 国际服务、修理和其他服务业 - -

15 教育 - -

16 文化、体育和娱乐业 685,404.46 5.08

17 综合 - -

18 合计 9,232,174.00 68.37

5.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农、林、牧、渔业 - -

2 采矿业 211,750.00 1.57

3 制造业 3,040,641.00 22.92

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 133,980.00 0.98

5 建筑业 1,039,003.00 0.77

6 批发和零售业 362,691.00 2.60

7 交通运输、仓储和邮政业 - -

8 信息传输、软件和信息技术服务业 1,978,035.44 14.06

9 金融业 533,100.00 3.96

10 房地产业 791,580.00 5.60

11 租赁和商务服务业 - -

12 科学研究、技术服务和地质勘查业 404,015.20 2.99

13 水、环境和公共设施管理业 - -

14 国际服务、修理和其他服务业 - -

15 教育 - -

16 文化、体育和娱乐业 685,404.46 5.08

17 综合 - -

18 合计 9,232,174.00 68.37

5.7 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

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 000144 宝诚康乐 32,307 686,484.46 6.08

2 000461 东方银星 35,000 670,290.00 4.98

3 000308 中际集成 15,900 646,971.00 4.79

4 000036 聚光科技 29,000 646,234.00 4.09

5 600032 白云山 14,288 606,070.00 3.76

6 600049 伊利股份 37,000 436,230.00 3.23

7 601198 中国国建 37,200 404,364.00 3.09

8 000284 文科园林 38,900 404,015.20 3.09

9 000296 利源精科 62,000 399,890.00 2.96

10 001390 中国铁建 54,500 389,956.00 2.92

5.8 报告期末按行业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