

南方人工智能主题混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

构建,合性中”,并没有撒手,反思还是对行情预判的广度和深度没有足够重视。展望未来,我认为从一季度的流动性宽松行情转变为经济复苏行情,投资逻辑从主题驱动导向基本面驱动主导,我们将更加重视基本面和公司质地,重点寻找科技股、消费升级、高端制造业等三大方向,并针对优质个股提高持仓集中度,增强组合的阿尔法获取超额回报。

4.5 报告期内基金的投资业绩和业绩比较基准
截至报告期末,本基金份额净值为1.2319元,报告期内,份额净值增长率为26.06%,同期业绩比较基准为28.05%。

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	42,273,364.40	81.06
2	其中:股票	42,273,364.40	81.06
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	9,331,693.06	15.96
9	合计	51,605,057.46	29.97
10	其中:买入返售金融资产	52,132,568.08	100.00

注:1.本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股市值为人民币:1,567,746,604元,占基金资产净值比例3.27%。

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	1,322.66	0.00
B	医药	-	-
C	制造业	14,861,926.29	31.91
D	电力、热力、燃气及生产供应业	968,226.00	1.19
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	540.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,227,686.00	2.56
H	信息传输、软件和信息技术服务业	16,873,042.29	33.32
J	金融业	4,209.00	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	国防军工行业	1,324,440.00	2.80
R	文化、体育和娱乐业	104,824.00	0.22
S	综合	34,316,494.44	72.53

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
材料	-	-
能源	-	-
非金属材料	-	-
医药	-	-
计算机	-	-
合计	7,966,860.04	16.70

注:以上分类采用彭博行业分类标准(BICS)。

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	00700	腾讯控股有限公司	12,000	3,715,596.28	7.80
2	01918	融创中国控股有限公司	80,000	2,683,167.12	5.63
3	000328	德威集团	220,000	2,667,000.00	5.63
4	300461	创世纪康	86,000	2,198,600.00	4.47
5	300170	汉鼎宇佑	120,000	2,032,800.00	4.27
6	002200	科大讯飞	53,200	1,530,964.61	3.19
7	002688	金鹰国际传媒集团有限公司	200,000	1,567,746.64	3.27
8	002406	福耀玻璃	66,300	1,481,004.00	3.11
9	300033	科恒花业	14,700	1,467,766.50	3.08
10	000728	德邦快递	120,044	1,466,557.68	3.08

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.5 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债券投资明细

5.6 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资产支持证券投资明细

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

5.8 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权证投资明细

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 本基金投资股指期货的投资政策

5.13 本基金投资国债期货的投资政策

5.14 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资产支持证券投资明细

5.15 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权证投资明细

5.16 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.17 投资组合报告附注

5.18 本基金投资股指期货的投资政策

5.19 本基金投资国债期货的投资政策

5.20 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资产支持证券投资明细

5.21 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权证投资明细

5.22 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.23 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.24 投资组合报告附注

5.25 本基金投资股指期货的投资政策

5.26 本基金投资国债期货的投资政策

5.27 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

5.28 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债券投资明细

5.29 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资产支持证券投资明细

5.30 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权证投资明细

5.31 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.32 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.33 投资组合报告附注

5.34 本基金投资股指期货的投资政策

5.35 本基金投资国债期货的投资政策

5.36 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

5.37 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债券投资明细

5.38 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资产支持证券投资明细

5.39 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权证投资明细

5.40 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.41 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.42 投资组合报告附注

5.43 本基金投资股指期货的投资政策

5.44 本基金投资国债期货的投资政策

5.45 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

5.46 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债券投资明细

5.47 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资产支持证券投资明细

5.48 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权证投资明细

5.49 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.50 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.51 投资组合报告附注

5.52 本基金投资股指期货的投资政策

5.53 本基金投资国债期货的投资政策

5.54 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

5.55 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债券投资明细

5.56 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资产支持证券投资明细

5.57 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权证投资明细

5.58 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.59 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.60 投资组合报告附注

5.61 本基金投资股指期货的投资政策

5.62 本基金投资国债期货的投资政策

5.63 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

5.64 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债券投资明细

5.65 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资产支持证券投资明细

5.66 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权证投资明细

5.67 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.68 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.69 投资组合报告附注

5.70 本基金投资股指期货的投资政策

5.71 本基金投资国债期货的投资政策

5.72 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

5.73 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债券投资明细

5.74 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资产支持证券投资明细

5.75 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权证投资明细

5.76 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.77 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.78 投资组合报告附注

5.79 本基金投资股指期货的投资政策

5.80 本基金投资国债期货的投资政策

5.81 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

5.82 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债券投资明细

5.83 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资产支持证券投资明细

5.84 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权证投资明细

5.85 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.86 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.87 投资组合报告附注

5.88 本基金投资股指期货的投资政策

5.89 本基金投资国债期货的投资政策

5.90 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

5.91 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债券投资明细

5.92 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资产支持证券投资明细

5.93 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权证投资明细

5.94 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.95 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.96 投资组合报告附注

5.97 本基金投资股指期货的投资政策

5.98 本基金投资国债期货的投资政策

5.99 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

5.100 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债券投资明细

5.101 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资产支持证券投资明细

5.102 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权证投资明细

5.103 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.104 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.105 投资组合报告附注

5.106 本基金投资股指期货的投资政策

5.107 本基金投资国债期货的投资政策

5.108 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

5.109 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债券投资明细

5.110 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资产支持证券投资明细

5.111 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权证投资明细

5.112 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.113 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.114 投资组合报告附注

5.115 本基金投资股指期货的投资政策

5.116 本基金投资国债期货的投资政策

5.117 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

5.118 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债券投资明细

5.119 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资产支持证券投资明细

5.120 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权证投资明细

5.121 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.122 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.123 投资组合报告附注

5.124 本基金投资股指期货的投资政策

5.125 本基金投资国债期货的投资政策

5.126 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

5.127 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债券投资明细

5.128 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资产支持证券投资明细

5.129 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权证投资明细

5.130 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.131 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.132 投资组合报告附注

5.133 本基金投资股指期货的投资政策

5.134 本基金投资国债期货的投资政策

5.135 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

5.136 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债券投资明细

5.137 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资产支持证券投资明细

5.138 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权证投资明细

5.139 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.140 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.141 投资组合报告附注

5.142 本基金投资股指期货的投资政策

5.143 本基金投资国债期货的投资政策

5.144 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

5.145 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债券投资明细

5.146 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资产支持证券投资明细

5.147 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权证投资明细

5.148 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.149 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.150 投资组合报告附注

5.151 本基金投资股指期货的投资政策

5.152 本基金投资国债期货的投资政策

5.153 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

5.154 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债券投资明细

5.155 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资产支持证券投资明细

5.156 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权证投资明细

5.157 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.158 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.159 投资组合报告附注

5.160 本基金投资股指期货的投资政策

5.161 本基金投资国债期货的投资政策

5.162 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

5.163 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债券投资明细

5.164 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资产支持证券投资明细

5.165 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权证投资明细