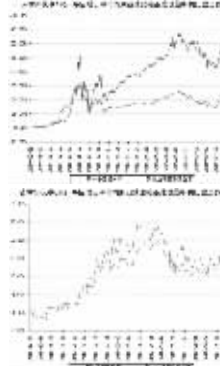


B134信息披露Disclosure

南方新优享灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金从2018年12月18日起新增C类份额,C类份额自2018年12月19日起存续。

4 管理人报告

姓名	职务	在本基金的管理期限(任职日期)	现任日期	证券从业资格	说明
李伟	基金经理	2018年5月20日	-	06E	北京大学经济学硕士,具有基金从业资格,担任研究部研究员,高级研究员,2018年4月加入本公司,任基金经理职务,2018年4月2日至2018年6月,任南方新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018年6月1日至2019年6月30日,任南方新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:1、本基金前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 管理人对于报告期内本基金运作遵守诚信情况的说明
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《证券投资基金管理人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 异常交易行为的专项说明
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,是由于投资组合接受投资者申赎后被动调仓以及指数成份股调整所致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
二季度市场震荡幅度加大,国内经济的高频数据开始转差,中美贸易战的进展影

响风险偏好,行业指数方面,一季度业绩最好的食品饮料行业一枝独秀,其他基本面稳健的核心资产也有绝对收益。传媒和受贸易战影响的相关行业跌幅都超过10%。

本基金虽然配置了部分核心资产,但对于贸易战对相关中小市值股票估值的影响有所抵消,导致净值表现不佳。
站在目前时点,经济仍有下行压力,核心资产的估值都处于历史偏高水平,我们认为市场延续之前极高风险的概率不大。我们将根据行业景气度选择估值合理的股票,力争获得超额收益。

4.5 报告期内基金的投资业绩
截至报告期末,本基金A份额净值为2.446元,报告期内,份额净值增长率为-2.38%,同期业绩比较增长率为-0.26%;本基金C份额净值为2.438元,报告期内,份额净值增长率为-2.00%,同期业绩比较增长率为-0.26%。

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基金资产净值低于五千万元的情形。

5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,332,267,000.01	76.14
2	其中:股票	2,332,267,000.01	76.14
3	固定收益投资	28,676,000.04	0.92
4	其中:债券	28,676,000.04	0.92
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	430,000,000.00	14.04
9	其中:买入返售金融资产-买入返售金融资产	-	-
10	合计	3,063,272,800.16	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	363,432.8	0.01
C	制造业	1,716,080,233.0	56.07
D	电力、热力、燃气生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	61,140,400.0	2.18
G	交通运输、仓储和邮政业	34,215,400.0	1.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	50,210,000.0	1.66
J	金融业	208,716,160.0	6.80
K	房地产业	62,438,750.0	2.06
L	租赁和商务服务业	140,480,125.0	4.61
M	科学研究和技术服务业	36,744,432.3	1.21
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	健康、体育和娱乐业	-	-
P	综合	-	-
Q	其他	-	-
R	合计	2,332,267,000.01	76.18

5.2.2 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。

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

代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	106,674,631.37	36.09
2	其中:股票	106,674,631.37	36.09
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	76,700,000.00	26.77
9	其中:买入返售金融资产-买入返售金融资产	-	-
10	合计	183,374,631.37	62.87

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	2,952,460.00	0.13
B	采矿业	2,038,465.28	0.79
C	制造业	47,236,243.72	17.25
D	电力、热力、燃气生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,000	0.00
F	批发和零售业	547,760.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	1,467,000.00	0.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,469,416.04	0.57
J	金融业	41,263,130.81	16.11
K	房地产业	7,038,960.02	2.87
L	租赁和商务服务业	9,833,499.00	3.89
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	707.49	0.00
O	健康、体育和娱乐业	-	-
P	综合	-	-
Q	其他	-	-
R	合计	106,674,631.37	41.06

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	2,952,460.00	0.13
B	采矿业	2,038,465.28	0.79
C	制造业	47,236,243.72	17.25
D	电力、热力、燃气生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,000	0.00
F	批发和零售业	547,760.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	1,467,000.00	0.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,469,416.04	0.57
J	金融业	41,263,130.81	16.11
K	房地产业	7,038,960.02	2.87
L	租赁和商务服务业	9,833,499.00	3.89
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	707.49	0.00
O	健康、体育和娱乐业	-	-
P	综合	-	-
Q	其他	-	-
R	合计	106,674,631.37	41.06

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股票投资组合

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	000001	平安银行	49,367	7,779,760.00	2.86
2	000033	荣信股份	87,000	4,090,762.00	1.50
3	000059	贵州茅台	3,700	3,640,000.00	1.33
4	000026	招商局A	62,840	3,487,440.00	1.28
5	000036	招商银行	56,500	3,436,000.00	1.28
6	000700	天正证券	229,200	3,138,464.00	1.17
7	000029	张裕A	267,000	2,930,220.00	1.07
8	000057	伊泰股份	76,400	2,952,740.00	0.99
9	000031	三一重工	177,000	2,913,300.00	0.98
10	000039	山东路桥	32,414	2,266,000.00	0.83

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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	118,614,304.41	77.76
2	其中:股票	118,614,304.41	77.76
3	固定收益投资	60,024,000.00	9.16
4	企业年金投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	买入返售金融资产	50,000,000.00	7.80
9	其中:买入返售金融资产-买入返售金融资产	-	-
10	合计	228,638,304.41	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	363,432.8	0.06
C	制造业	389,426,053.3	97.99
D	电力、热力、燃气生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,613,760.00	2.23
G	交通运输、仓储和邮政业	34,215,400.00	1.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	50,210,000.00	1.66
J	金融业	208,716,160.00	6.80
K	房地产业	14,039,066.00	2.14
L	租赁和商务服务业	36,816,527.02	6.61
M	科学研究和技术服务业	7,619,720.00	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	健康、体育和娱乐业	-	-
P	综合	-	-
Q	其他	-	-
R	合计	510,414,304.41	79.06

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股票投资组合

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	000001	平安银行	49,367	8,167,520.00	7.60
2	000033	荣信股份	87,000	47,710,750.00	7.24
3	000059	贵州茅台	3,700	48,087,914.00	7.27
4	000026	招商局A	62,840	2,930,220.00	1.07
5	000036	招商银行	56,500	2,936,000.00	1.08
6	000700	天正证券	229,200	2,913,300.00	1.01
7	000029	张裕A	267,000	2,930,220.00	1.07
8	000057	伊泰股份	76,400	2,952,740.00	1.09
9	000031	三一重工	177,000	2,913,300.00	1.01
10	000039	山东路桥	32,414	16,877,100.00	2.64

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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	118,614,304.41	77.76
2	其中:股票	118,614,304.41	77.76
3	固定收益投资	60,024,000.00	9.16
4	企业年金投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	买入返售金融资产	50,000,000.00	7.80
9	其中:买入返售金融资产-买入返售金融资产	-	-
10	合计	228,638,304.41	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	363,432.8	0.06
C	制造业	389,426,053.3	97.99
D	电力、热力、燃气生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,613,760.00	2.23
G	交通运输、仓储和邮政业	34,215,400.00	1.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	50,210,000.00	1.66
J	金融业	208,716,160.00	6.80
K	房地产业	14,039,066.00	2.14
L	租赁和商务服务业	36,816,527.02	6.61
M	科学研究和技术服务业	7,619,720.00	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	健康、体育和娱乐业	-	-
P	综合	-	-
Q	其他	-	-
R	合计	510,414,304.41	79.06

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	363,432.8	0.06
C	制造业	389,426,053.3	97.99
D	电力、热力、燃气生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,613,760.00	2.23
G	交通运输、仓储和邮政业	34,215,400.00	1.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	50,210,000.00	1.66
J	金融业	208,716,160.00	6.80
K	房地产业	14,039,066.00	2.14
L	租赁和商务服务业	36,816,527.02	6.61
M	科学研究和技术服务业	7,619,720.00	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	健康、体育和娱乐业	-	-
P	综合	-	-
Q	其他	-	-
R	合计	510,414,304.41	79.06

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	363,432.8	0.06
C	制造业	389,426,053.3	97.99
D	电力、热力、燃气生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,613,760.00	2.23
G	交通运输、仓储和邮政业	34,215,400.00	1.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	50,210,000.00	1.66
J	金融业	208,716,160.00	6.80
K	房地产业	14,039,066.00	2.14
L	租赁和商务服务业	36,816,527.02	6.61
M	科学研究和技术服务业	7,619,720.00	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	健康、体育和娱乐业	-	-
P	综合	-	-
Q	其他	-	-
R	合计	510,414,304.41	79.06

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	363,432.8	0.06
C	制造业	389,426,053.3	97.99
D	电力、热力、燃气生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,613,760.00	2.23
G	交通运输、仓储和邮政业	34,215,400.00	1.13
H	住宿和餐饮业		