

南方智造未来股票型证券投资基金

2019年第二季度报告

又开始加仓。其次,本基金二季度大幅度卖出计算机、电子等科技股,大幅加仓家电、医药等消费股,目前基金处于仓位偏高水平,投资主要集中在白酒、医药、家电和金融。未来本基金还将继续以绝对收益为投资理念,自上而下,精选个股,持续为持有人创造收益。

4.5 报告期内基金的投资业绩
截至报告期末,本基金份额净值为0.9060元,报告期内,份额净值增长率为0.31%,同期业绩基准增长率为-0.95%。

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量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

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	89,077,024.50	87.27
2	债券投资	89,077,024.50	87.27
3	基金投资	-	-
4	买入返售金融资产	5,197,740.00	5.08
5	银行存款	5,197,740.00	5.08
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	股指期货投资	-	-
9	国债期货投资	-	-
10	其他	-	-
11	银行存款和结算备付金合计	6,024,187.29	5.87
12	其他资产	102,279,062.23	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境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	医药、生物	1,470,260.78	1.46
B	电子	41,267.00	0.04
C	制造业	66,202,062.67	64.86
D	电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	538,400.00	0.52
F	批发和零售业	341,000.00	0.34
G	交通、运输、仓储及邮政业	1,769.22	0.00
H	信息传输、软件和信息技术服务业	1,148,100.23	1.14
J	金融业	15,038,002.48	14.88
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,294,003.14	2.28
M	科学研究和技术服务业	1,713.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,777,261.13	1.77
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.02
S	其他	89,077,024.50	88.43

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股投资股票。

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

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	000130	中粮地产	32,400	2,075,474.00	2.27
2	000008	招商地产	54,700	1,898,106.00	2.12
3	001051	恒悦环保	82,500	1,563,285.00	1.73
4	000519	贵州茅台	1,800	1,771,200.00	1.96
5	001189	招商证券	296,400	1,751,724.00	1.94
6	001009	南京证券	269,200	1,727,962.00	1.92
7	601098	中国建设	288,700	1,642,776.00	1.83
8	000001	工商银行	277,300	1,633,297.00	1.82
9	000008	招商银行	124,400	1,587,244.00	1.76
10	000000	中国平安	61,700	1,469,070.00	1.63

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	22,964,767.23	22.66
2	基金投资	22,964,767.23	22.66
3	买入返售金融资产	-	-
4	债券投资	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	股指期货投资	-	-
8	国债期货投资	-	-
9	其他	75,506,440.00	74.68

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十名债券投资明细

代码	债券名称	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	央行票据	6,132,267.88	6.04
B	国债	941,200.00	0.93
C	地方政府债	1,642,776.00	1.62
D	交通银行	1,587,244.00	1.57
E	招商银行	538,002.48	0.53
F	工商银行	13,265,740.23	13.12
G	浦发银行	1,587,244.00	1.57
H	民生银行	2,294,003.14	2.28
I	光大银行	1,713.00	0.00
J	中信银行	13,265,740.23	13.12
K	兴业银行	1,587,244.00	1.57
L	交通银行	2,294,003.14	2.28
M	光大银行	1,713.00	0.00
N	光大银行	1,713.00	0.00
O	交通银行	13,265,740.23	13.12
P	光大银行	1,713.00	0.00
Q	交通银行	13,265,740.23	13.12
R	光大银行	1,713.00	0.00
S	交通银行	13,265,740.23	13.12

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	101900001	19国债01	1,000,000	101,700,000.00	7.43
2	101900004	19国债04	1,200,000	120,200,000.00	8.88
3	1622018	18国债01	1,000,000	102,000,000.00	7.43
4	190401	19国债01	1,000,000	100,200,000.00	7.30
5	101900003	19国债03	900,000	98,412,000.00	7.23

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内本基金投资的前十名证券除工商银行(证券代码601398)、招商银行(证券代码600036)外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 声明本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是,还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求投资必须先买入再买入。

5.11.3 其他资产构成

5.12 影响投资者决策的其他重要信息

5.13 备查文件目录

1、《南方弘利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》;

2、《南方弘利定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》;

3、南方弘利定期开放债券型发起式证券投资基金2019年2季度报告原文。

10.2 存放地点
深圳市福田区莲花街道益田路6999号基金大厦32-42楼。

10.3 查阅方式
网站: http://www.nffund.com

10.4 联系方式
基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月16日

基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司