

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

构购进,合位中性”,并没有跑赢指数,反思还是对行情反演的力度和速度没有足够重视。

展望二季度,我们认为将从一季度的流动宽松转为经济复苏行情,行业选择行情,投资逻辑从主题逻辑主导向基本面驱动主导,我们将更加注重基本面和公司质地,重点研究科技创新、消费升级、高端制造等三大方向,并针对个股股价高估股票做调整,增强组合的阿尔法来获得超额收益。

45 报告期内基金的业绩表现

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25.45%,同期业绩基准增长率为20.05%。

46 本基金年内持有人数或基金份额净值预警说明

报告期内,本基金未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份额净值低于五万元人民币的。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金份额持有人情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1	权益投资	42,273,354.48	81.06
2	基金投资	42,273,354.48	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	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	8,331,503.06	15.98
10	其他资产	1,547,608.34	2.97
11	合计	62,162,566.88	100.00

注:本基金于2018年10月12日生效,截至本报告期末基金成立未满一年;自基金成立日起6个月内为建仓期,建仓期结束后各资产配置比例符合合同约定。

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 在本基金的基金管理期限 任职日期 离任日期

罗安安 本基金基金经理 2018年10月12日 - 8年

说明:本基金主要采用定量和定性的方法投资股票资产,在严格控制风险的前提下,通过深入研究,把握未来经济的走势及国内经济政策的调整,寻找具有投资价值的品种,同时兼顾市场流动性,降低个别股票的风险。本基金在严格控制风险的基础上,基于对市场的成功经验,选择具有竞争优势,并且具有良好的投资价值的股票,精选具有持续盈利能力的公司,以获取超额收益。

4.2 中证人工智能指数收益率×60%+中证港股通综合指数收益率×10%+恒生综合指数收益率×30%

4.3 风险收益特征

本基金为混合型基金,属于中高风险、中高预期收益的基金品种,一般而言,预期风险收益水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。本基金在严格控制风险的基础上,基于对市场的成功经验,选择具有竞争优势,并且具有良好的投资价值的股票,精选具有持续盈利能力的公司,以获取超额收益。

4.4 基金管理人对本基金的评价

4.5 基金托管人对本基金的评价

4.6 基金类别

4.7 主要财务指标

4.8 基金净值表现

4.9 报告期基金单位净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

5.1 报告期末基金份额净值

5.2 主要财务指标和基金净值表现

5.3 主要财务指标

5.4 报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

5.5 报告期末基金份额净值

5.6 报告期基金资产组合情况

5.7 报告期期末基金份额持有人数

5.8 报告期期末基金份额净值

5.9 报告期期末基金份额总额

5.10 报告期期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11 报告期期末持有的处于质押状态的债券

5.12 报告期期末持有的处于冻结状态的债券

5.13 其他资产构成

5.14 报告期期末持有的处于未到期的国债

5.15 报告期期末持有的处于未到期的金融债

5.16 报告期期末持有的处于未到期的次级债

5.17 报告期期末持有的处于未到期的信用债

5.18 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债

5.19 报告期期末持有的处于未到期的权证

5.20 报告期期末持有的处于未到期的资产支持证券

5.21 报告期期末持有的处于未到期的国债期货

5.22 报告期期末持有的处于未到期的信用债期货

5.23 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债期货

5.24 报告期期末持有的处于未到期的权证期货

5.25 报告期期末持有的处于未到期的股指期货

5.26 报告期期末持有的处于未到期的国债期权

5.27 报告期期末持有的处于未到期的信用债期权

5.28 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债期权

5.29 报告期期末持有的处于未到期的权证期权

5.30 报告期期末持有的处于未到期的股指期权

5.31 报告期期末持有的处于未到期的国债ETF期权

5.32 报告期期末持有的处于未到期的信用债ETF期权

5.33 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债ETF期权

5.34 报告期期末持有的处于未到期的权证ETF期权

5.35 报告期期末持有的处于未到期的股指ETF期权

5.36 报告期期末持有的处于未到期的国债ETF联接基金

5.37 报告期期末持有的处于未到期的信用债ETF联接基金

5.38 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债ETF联接基金

5.39 报告期期末持有的处于未到期的权证ETF联接基金

5.40 报告期期末持有的处于未到期的股指ETF联接基金

5.41 报告期期末持有的处于未到期的国债LOF期权

5.42 报告期期末持有的处于未到期的信用债LOF期权

5.43 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债LOF期权

5.44 报告期期末持有的处于未到期的权证LOF期权

5.45 报告期期末持有的处于未到期的股指LOF期权

5.46 报告期期末持有的处于未到期的国债ETF期权

5.47 报告期期末持有的处于未到期的信用债ETF期权

5.48 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债ETF期权

5.49 报告期期末持有的处于未到期的权证ETF期权

5.50 报告期期末持有的处于未到期的股指ETF期权

5.51 报告期期末持有的处于未到期的国债LOF期权

5.52 报告期期末持有的处于未到期的信用债LOF期权

5.53 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债LOF期权

5.54 报告期期末持有的处于未到期的权证LOF期权

5.55 报告期期末持有的处于未到期的股指LOF期权

5.56 报告期期末持有的处于未到期的国债ETF联接基金

5.57 报告期期末持有的处于未到期的信用债ETF联接基金

5.58 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债ETF联接基金

5.59 报告期期末持有的处于未到期的权证ETF联接基金

5.60 报告期期末持有的处于未到期的股指ETF联接基金

5.61 报告期期末持有的处于未到期的国债LOF期权

5.62 报告期期末持有的处于未到期的信用债LOF期权

5.63 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债LOF期权

5.64 报告期期末持有的处于未到期的权证LOF期权

5.65 报告期期末持有的处于未到期的股指LOF期权

5.66 报告期期末持有的处于未到期的国债ETF期权

5.67 报告期期末持有的处于未到期的信用债ETF期权

5.68 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债ETF期权

5.69 报告期期末持有的处于未到期的权证ETF期权

5.70 报告期期末持有的处于未到期的股指ETF期权

5.71 报告期期末持有的处于未到期的国债LOF期权

5.72 报告期期末持有的处于未到期的信用债LOF期权

5.73 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债LOF期权

5.74 报告期期末持有的处于未到期的权证LOF期权

5.75 报告期期末持有的处于未到期的股指LOF期权

5.76 报告期期末持有的处于未到期的国债ETF期权

5.77 报告期期末持有的处于未到期的信用债ETF期权

5.78 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债ETF期权

5.79 报告期期末持有的处于未到期的权证LOF期权

5.80 报告期期末持有的处于未到期的股指LOF期权

5.81 报告期期末持有的处于未到期的国债ETF期权

5.82 报告期期末持有的处于未到期的信用债ETF期权

5.83 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债ETF期权

5.84 报告期期末持有的处于未到期的权证LOF期权

5.85 报告期期末持有的处于未到期的股指LOF期权

5.86 报告期期末持有的处于未到期的国债ETF期权

5.87 报告期期末持有的处于未到期的信用债ETF期权

5.88 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债ETF期权

5.89 报告期期末持有的处于未到期的权证LOF期权

5.90 报告期期末持有的处于未到期的股指LOF期权

5.91 报告期期末持有的处于未到期的国债ETF期权

5.92 报告期期末持有的处于未到期的信用债ETF期权

5.93 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债ETF期权

5.94 报告期期末持有的处于未到期的权证LOF期权

5.95 报告期期末持有的处于未到期的股指LOF期权

5.96 报告期期末持有的处于未到期的国债ETF期权

5.97 报告期期末持有的处于未到期的信用债ETF期权

5.98 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债ETF期权

5.99 报告期期末持有的处于未到期的权证LOF期权

5.100 报告期期末持有的处于未到期的股指LOF期权

5.101 报告期期末持有的处于未到期的国债ETF期权

5.102 报告期期末持有的处于未到期的信用债ETF期权

5.103 报告期期末持有的处于未到期的分离交易可转债ETF期权

5.104 报告期期末持有的处于未到期的权证LOF期权