

# 南方甄智定期开放混合型发起式证券投资 基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 10 月 25 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 6 日（基金合同生效日）起至 2016 年 09 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	南方甄智定期开放混合型发起式
交易代码	002850
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 7 月 6 日
报告期末基金份额总额	1,164,605,610.92 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方甄智”。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年7月6日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	3,978,483.57
2. 本期利润	-5,279,819.30
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0045
4. 期末基金资产净值	1,159,325,791.62
5. 期末基金份额净值	0.995

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

2. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 本基金合同生效日为 2016 年 7 月 6 日。

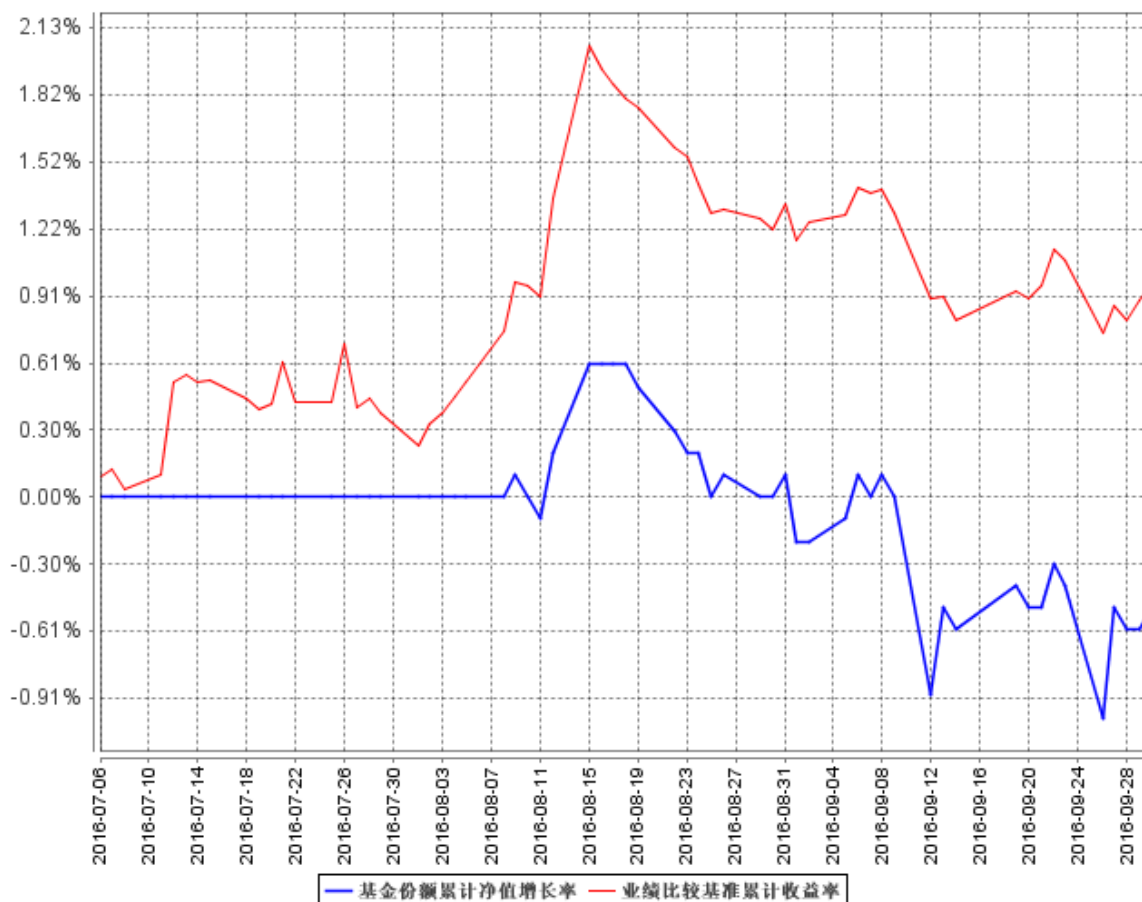
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	-0.50%	0.20%	0.97%	0.17%	-1.47%	0.03%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日至本报告期末不满 1 年；本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，截至本报告期末，建仓期尚未结束。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘文良	本基金基金经理	2016 年 7 月 6 日	-	4 年	北京大学金融学专业硕士，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入南方基金，历任固定收益部转债研究员、宏观研究员、信用分析师；2015 年 2 月至 2015 年 8 月，任南方永利基金经理助理；2015 年 8 月至今，任南方永利基金经理；2015 年 12 月至今，任南方弘利、南方安心基金经理；2016 年 6 月至今，任南方广利基金经理；

					2016 年 7 月至今，任南方甄智混合基金经理。
赵凤学	本基金基金经理	2016 年 7 月 6 日	-	8 年	北京大学硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于北京建工集团有限公司、京能置业股份有限公司和首创置业股份有限公司。2008 年 4 月至 2015 年 8 月任职于新华资产管理股份有限公司，先后担任研究员、投资经理等职务，自 2011 年 6 月起管理分红险和投资连结险的股票投资账户。2015 年 8 月加入南方基金；2016 年 5 月至今，任南方新兴混合基金经理；2016 年 7 月至今，任南方甄智混合基金经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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《南方甄智定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》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《证券投资基金管理公司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，未出现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% 的情况。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

前三季度，在经济运行方面，得益于国家政策的支持，经济运行总体平稳，运行质量有所改善。物价和通胀水平总体平稳；在供给侧改革、一带一路和转型升级等重要发展方向上稳步推进，

新经济发展势头良好；传统行业中房地产行业出现量价齐升的局面。

前三季度，在市场运行方面，年初受人民币汇率贬值和熔断制度的影响，前两月份市场表现较差。之后，受益于国内经济运行状况的好转、市场负面情绪的衰减，以及美联储鸽派信号加强、美元升值步伐放缓和大宗商品市场表现较好等因素，A 股市场触底回升，结构性行情比较明显。

前三季度，在投资操作方面，我们秉持追求绝对收益的原则，稳健操作，在新兴产业方面进行了有效布局；同时，也积极参与定向增发投资，由于市场在定向增发投资方面比较激进，出现折价率较低的局面，在此情况下，我们没有受市场的影响，进行了合理报价。

展望四季度，我们对市场的判断不悲观。在国际方面，一些负面因素在弱化。在国内方面，政策有的放矢，对经济和市场起到良好的支撑作用；经济运行平稳，有进一步改善的空间；流动性和市场情绪均有所好转。我们将积极把握四季度可能出现的追求绝对收益的良机，以期为投资者获得稳健的回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期南方甌智混合基金净值增长约为-0.50%，同期业绩比较基准增长率为 0.97%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §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	305,471,290.79	23.91
	其中：股票	305,471,290.79	23.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	912,083,071.10	71.39
	其中：债券	912,083,071.10	71.39
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	51,151,611.20	4.00
8	其他资产	8,908,990.30	0.70
9	合计	1,277,614,963.39	100.00

## 5.2 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	-	-
C	制造业	158,172,298.50	13.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,118,254.13	0.87
F	批发和零售业	32,547.63	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,213,415.63	4.59
J	金融业	84,909.44	0.01
K	房地产业	58,569,865.46	5.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	17,930,000.00	1.55
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	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,350,000.00	0.63
S	综合	-	-
	合计	305,471,290.79	26.35

## 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	600606	绿地控股	2,999,986	28,829,865.46	2.49
2	002192	融捷股份	750,000	20,700,000.00	1.79
3	000718	苏宁环球	2,000,000	17,120,000.00	1.48
4	000671	阳光城	2,000,000	12,620,000.00	1.09
5	002153	石基信息	500,400	12,219,768.00	1.05
6	002709	天赐材料	250,000	11,720,000.00	1.01
7	002031	巨轮智能	3,100,000	11,284,000.00	0.97
8	300274	阳光电源	900,000	10,521,000.00	0.91
9	300470	日机密封	250,000	10,492,500.00	0.91

10	002051	中工国际	500,000	10,025,000.00	0.86
----	--------	------	---------	---------------	------

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	336,843,443.60	29.06
5	企业短期融资券	225,370,500.00	19.44
6	中期票据	81,646,000.00	7.04
7	可转债（可交换债）	215,127.50	0.02
8	同业存单	268,008,000.00	23.12
9	其他	-	-
10	合计	912,083,071.10	78.67

#### 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

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	136176	16 绿地 01	500,000	49,630,000.00	4.28
2	122200	12 晋兰花	400,000	39,636,000.00	3.42
3	122337	13 魏桥 02	300,000	31,749,000.00	2.74
4	101355009	13 中铝业 MTN001	300,000	31,515,000.00	2.72
5	122826	11 北港债	310,000	31,440,200.00	2.71

#### 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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

注：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

注：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

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

### 5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	84,812.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,824,177.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,908,990.30

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年7月6日）基金份额总额	1,164,605,610.92
--------------------------	------------------

报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,164,605,610.92

注:本基金合同生效日为 2016 年 7 月 6 日。

## §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

单位:份

基金合同生效日(2016年7月6日)管理人持有的本基金份额	10,007,389.62
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	0.00
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,007,389.62
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.86

注:本基金合同生效日为 2016 年 7 月 6 日。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

## §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,007,389.62	0.86	9,900,000.00	0.85	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	117,634.46	0.01	100,000.00	0.01	自合同生效之

					日起不少于 3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,125,024.08	0.87	10,000,000.00	0.86	自合同生效之 日起不少于 3 年

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、南方甄智定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同
- 2、南方甄智定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议
- 3、南方甄智定期开放混合型发起式证券投资基金 2016 年 3 季度报告原文

### 9.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

### 9.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>