

南方稳健成长贰号证券投资基金 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：中国工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。

基金托管人中国工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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 2016 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方稳健成长贰号混合
交易代码	202002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 7 月 25 日
报告期末基金份额总额	4,479,543,941.41 份
投资目标	本基金为稳健成长型基金，在控制投资风险并保持基金投资组合良好的流动性的前提下，力求使该为投资者提供稳健和长期稳定的资本利得。
投资策略	在股票投资方面，本基金根据上市公司的获利能力和成长潜力，主要可以区分为价值型股票和成长型股票。本基金明确界定了价值型和成长型股票的特征，并依据该特征分别构造一个投资组合。本基金投资于这两个组合内股票的比例不低于股票投资部分的 80%。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为上证综合指数×80%+上证国债指数×20%。
风险收益特征	本基金为混合基金，属证券投资基金中的风险收益适中的品种。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工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“南稳贰号”。

§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1日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	93,447,469.82
2. 本期利润	18,750,490.37
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0041
4. 期末基金资产净值	1,880,466,204.92
5. 期末基金份额净值	0.4198

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。

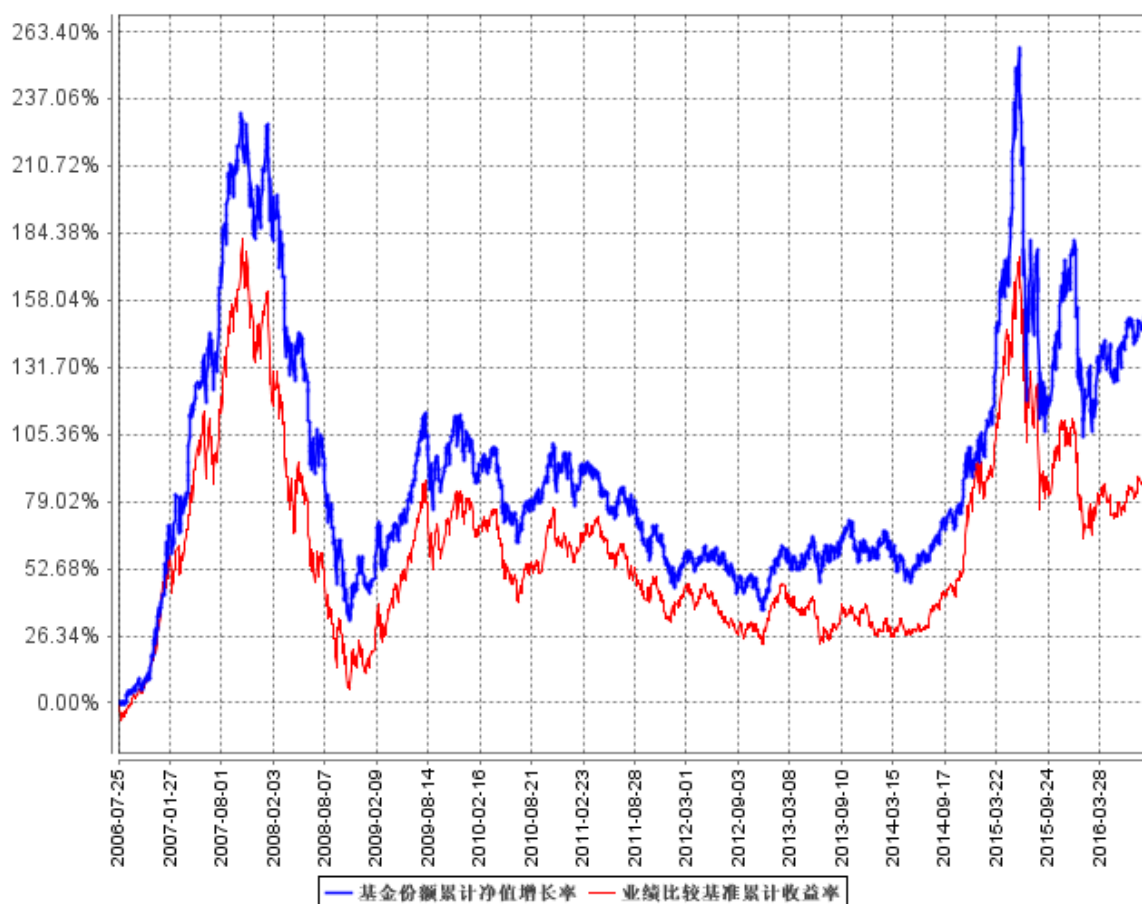
3.2 基金净值表现

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	0.99%	0.62%	2.34%	0.62%	-1.35%	0.00%

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



§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		
应帅	本基金基金经理	2012年 11月23日	-	15年	北大光华管理学院管理学硕士，具有基金从业资格。曾担任长城基金管理公司行业研究员，2007年加入南方基金，2007年5月至2009年2月，任南方宝元基金经理；2007年5月至2012年11月，任南方成份基金经理；

					2010 年 12 月至 2016 年 3 月，任南方宝元基金经理； 2012 年 11 月至今，任南方稳健基金经理； 2012 年 11 月至今，任南稳贰号基金经理； 2016 年 3 月至今，任南方驱动基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《南方稳健成长贰号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

2016 年三季度国内宏观经济平稳运行，房地产市场继续强势运行，人民币汇率弱势调整。国内资本市场在 3 月份反弹之后，进入了窄幅震荡整理区间，三季度市场虽有上涨，但幅度微弱，难以形成趋势性行情。三季度，前期热点主题有所退潮，尤其是新能源汽车板块下跌幅度较大。

本基金三季度一直维持较为稳定的仓位，较少择时，注重行业和个股配置。三季度本基金主要增加了金融、地产和 PPP 主题板块，而在新能源汽车、食品饮料上则进行了整体减持。本基金将继续采取自下而上的选股策略，争取获得较好的绝对收益和相对收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2016 年三季度沪深 300 指数增长率为 3.15%，基金净值增长率为 0.99%，业绩基准为 2.34%。

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	1,307,863,627.04	69.26
	其中：股票	1,307,863,627.04	69.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	413,041,909.70	21.87
	其中：债券	413,041,909.70	21.87
	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	150,306,343.78	7.96
8	其他资产	17,197,414.45	0.91
9	合计	1,888,409,294.97	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）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	15,606,000.00	0.83
B	采矿业	-	-
C	制造业	693,444,284.70	36.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,896,910.48	0.95

E	建筑业	121,848,560.60	6.48
F	批发和零售业	32,547.63	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	29,229,936.00	1.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,365,110.11	2.36
J	金融业	282,170,129.12	15.01
K	房地产业	55,527,300.00	2.95
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	16,658,048.40	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	22,164,800.00	1.18
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	8,920,000.00	0.47
S	综合	-	-
	合计	1,307,863,627.04	69.55

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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	600273	嘉化能源	7,859,500	73,014,755.00	3.88
2	601166	兴业银行	4,500,000	71,865,000.00	3.82
3	002304	洋河股份	956,525	64,173,262.25	3.41
4	600978	宜华生活	5,269,868	60,445,385.96	3.21
5	000333	美的集团	1,985,950	53,640,509.50	2.85
6	600030	中信证券	3,313,600	53,415,232.00	2.84
7	600519	贵州茅台	140,900	41,975,519.00	2.23
8	002466	天齐锂业	1,045,384	39,776,861.20	2.12
9	600266	北京城建	2,790,000	38,139,300.00	2.03
10	601998	中信银行	6,349,903	37,972,419.94	2.02

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	95,787,500.00	5.09

2	央行票据	-	-
3	金融债券	317,254,409.70	16.87
	其中：政策性金融债	317,254,409.70	16.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	413,041,909.70	21.96

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	080220	08 国开 20	1,900,000	192,641,000.00	10.24
2	110417	11 农发 17	500,000	50,045,000.00	2.66
3	150024	15 付息国 债 24	500,000	50,010,000.00	2.66
4	110322	11 进出 22	300,000	30,081,000.00	1.60
5	130247	13 国开 47	200,000	22,308,000.00	1.19

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

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情况。本基金投资的前十名证券的发行主体没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	669,039.60
2	应收证券清算款	4,834,253.81
3	应收股利	20,000.00
4	应收利息	11,466,144.42
5	应收申购款	207,976.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,197,414.45

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情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	4,559,631,749.48
报告期期间基金总申购份额	55,058,487.50
减：报告期期间基金总赎回份额	135,146,295.57
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	4,479,543,941.41

§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

注：基金管理人未持有本基金份额。

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、《南方稳健成长贰号证券投资基金基金合同》。
- 2、《南方稳健成长贰号证券投资基金托管协议》。
- 3、南方稳健成长贰号证券投资基金 2016 年 3 季度报告原文。

8.2 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

8.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>