

南方荣毅定期开放混合型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告

2017 年 09 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2017 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 24 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 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	南方荣毅定期开放混合
基金主代码	002931
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 08 月 03 日
报告期末基金份额总额	99,314,996.28 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×10%+中债综合指数收益率×90%
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	中国银行股份有限公司

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“南方荣毅”。

§ 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(2017年07月01日 - 2017年09月30日)
1. 本期已实现收益	10,428,718.40
2. 本期利润	2,914,942.79
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0099
4. 期末基金资产净值	99,866,641.32
5. 期末基金份额净值	1.006

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收益；

2、所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	1.62%	0.10%	0.32%	0.06%	1.30%	0.04%

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

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		
郑迎迎	本基金基金经理	2017年9月7日		9年	女，中国人民大学金融学硕士，具有基金从业资格。曾先后就职于农银汇理基金、富国基金，历任行业研究员、信用研究员、基金经理；2012年10月至2015年1月，任富国7天理财宝基金经理；2013年1月至2015年4月，任富国强回报基金经理；2014年3月至2016年10月，任富国可转换债券基金经理；2015年4月至2017年3月，任富国新天锋、富国收益增强基金经理；2015年8月至2016年9月，任富国新动力基金经理；2016年1月至2017年3月，任富国稳健增强基金经理。2017年6月加入南方基金；2017年8月至今，任南方高元、南方荣光、南方通

					利基金经理；2017 年 9 月至今，任南方荣毅基金经理。
王啸	本基金基金经理	2016 年 12 月 9 日		4 年	香港大学金融学硕士，具有基金从业资格。2013 年 8 月加入南方基金，历任信用分析师、转债研究员、新股研究员。2016 年 3 月至 2016 年 12 月，任南方通利、南方丰元、南方双元的基金经理助理。2016 年 12 月至今，任南方荣光、南方荣冠、南方荣欢、南方荣毅、南方荣安、南方荣发基金经理。
陶铄	本基金基金经理	2016 年 8 月 3 日	2017 年 9 月 7 日	15 年	清华大学应用数学专业学士，中国科学院金融工程专业硕士，具有基金从业资格。曾任职于招商银行总行、普华永道会计师事务所、穆迪投资者服务有限公司、中国国际金融有限公司；2010 年 9 月至 2014 年 9 月任职于大成基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理；2012 年 2 月至 2014 年 9 月任大成景丰分级债券型基金的基金经理；2012 年 5 月至 2012 年 10 月任大成货币市场基金的基金经理；2012 年 9 月至 2014 年 4 月任大成月添利基金的基金经理；2012 年 11 月至 2014 年 4 月任大成月月盈基金的基金经理；2013 年 5 月至 2014 年 9 月任大成景安基金的基金经理；2013 年 6 月至 2014 年 9 月任大成景兴基金的基金经理；2014 年 1 月至 2014 年 9 月任大成信用增利基金的基金经理。2014 年 9 月加入南方基金产品开发部，从

					<p>事产品研发工作；2014 年 12 月至 2015 年 12 月，任固定收益部资深研究员，现任固定收益研究部负责人；2016 年 8 月至 2017 年 9 月，任南方荣毅基金经理；2015 年 12 月至今，任南方启元基金经理；2016 年 1 月至今，任南方弘利、南方聚利基金经理；2016 年 8 月至今，任南方荣欢、南方双元基金经理；2016 年 9 月至今，任南方颐元基金经理；2016 年 11 月至今，任南方荣光基金经理；2016 年 12 月至今，任南方宣利基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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《南方荣毅定期开放混合型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 3 次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数型基金成份股调整所致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度经济数据整体表现有所弱化，综合来看经济下行压力持续存在，通胀水平尚不构成显著的制约，对于中长期债市仍然利好。三季度资金普遍紧张的情况下，债券市场出现小幅调整，但是权益的结构性行情却非常丰富。在当前紧信用的背景下，企业融资环境恶化，需要严防信用风险，加强对于持仓债券的跟踪和梳理。

投资运作上，三季度适逢本组合上一个封闭期结束，迎来新的封闭期。策略上也做了调整，债券依然维持短久期，但权益市场的选股更加积极，很多上市公司三季度业绩持续得到验证，在此过程中，组合筛选到部分良好表现的个股，带来较为丰厚的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期南方荣毅定期开放基金净值增长率为 1.62%，同期业绩比较基准增长率为 0.32%。

4.5 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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	15,598,206.24	14.14
	其中：股票	15,598,206.24	14.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	49,359,614.58	44.75
	其中：债券	49,359,614.58	44.75
	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	39,100,000.00	35.45
	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	291,287.88	0.26
8	其他资产	5,952,610.82	5.40
9	合计	110,301,719.52	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	-	-
B	采矿业	39,793.60	0.04
C	制造业	10,173,016.00	10.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,833,642.00	2.84
G	交通运输、仓储和邮政业	1,006,064.64	1.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,545,690.00	1.55
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	15,598,206.24	15.62

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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	600197	伊力特	108,900	2,504,700.00	2.51
2	002640	跨境通	77,700	1,808,079.00	1.81
3	002597	金禾实业	71,600	1,585,940.00	1.59
4	002027	分众传媒	153,800	1,545,690.00	1.55
5	600887	伊利股份	41,700	1,146,750.00	1.15
6	002332	仙琚制药	118,200	1,031,886.00	1.03
7	000963	华东医药	20,900	1,025,563.00	1.03

8	002120	韵达股份	21,833	1,006,064.64	1.01
9	300136	信维通信	23,900	1,003,800.00	1.01
10	601222	林洋能源	112,600	998,762.00	1.00

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	5,004,000.00	5.01
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	43,372,871.08	43.43
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	982,743.50	0.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,359,614.58	49.43

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	143288	17 国联 02	50,000	5,004,000.00	5.01
2	112156	12 中顺债	47,000	4,710,340.00	4.72
3	112129	12 华锦债	47,000	4,700,940.00	4.71
4	122430	15 增碧 02	47,000	4,685,430.00	4.69
5	122412	15 昆药债	47,000	4,678,380.00	4.68

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 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

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 声明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（人民币元）
1	存出保证金	221,377.03
2	应收证券清算款	4,799,328.58
3	应收股利	-
4	应收利息	931,905.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,952,610.82

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	593,991,105.04
报告期期间基金总申购份额	54,044.50
减：报告期期间基金总赎回份额	494,730,153.26
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	99,314,996.28

§ 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、南方荣毅定期开放混合型证券投资基金基金合同
- 2、南方荣毅定期开放混合型证券投资基金托管协议
- 3、南方荣毅定期开放混合型证券投资基金 2017 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>