

南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金 2018年3季度报告

2018年09月30日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2018年10月26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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 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 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南方潜力新蓝筹混合
基金主代码	000327
交易代码	000327
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 6 月 5 日
报告期末基金份额总额	212,215,524.81 份
投资目标	本基金为混合型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，采用定量和定性的投资方法，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金所指的潜力新蓝筹股票是指中小市值上市公司中业绩优良、发展稳定、红利优厚、品牌价值逐渐显现的上市公司股票。本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，定期或不定期地进行调整，以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	$80\% \times \text{中证 700 指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，一般而言，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股

	票型基金。本基金主要投资于中小市值股票,在混合型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

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“南方新蓝筹混合”。

§ 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（2018 年 7 月 1 日—2018 年 9 月 30 日）
1.本期已实现收益	419,437.00
2.本期利润	-1,424,146.73
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0063
4.期末基金资产净值	233,872,321.85
5.期末基金份额净值	1.1021

注：1、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；

2、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。

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	-0.56%	0.23%	-6.38%	1.07%	5.82%	-0.84%

注：本基金由原南方丰合保本混合型证券投资基金 2018 年 6 月 4 日到期后转型而来，于 2018 年 6 月 5 日转型为南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金。

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

南方潜力新蓝筹混合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：1. 本基金转型日期为 2018 年 6 月 5 日，截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未
满一年。

2. 本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，截止本报告期末建仓期未结束。

§ 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		
孙鲁闽	本基金 基金经 理	2018 年 6 月 5 日	-	15 年	南开大学理学和经济学双学士、澳大利亚新南威尔士大学商学硕士，具有基金从业资格。曾任职于厦门国际银行福州分行，2003 年 4 月加入南方基金，历任行业研究员、南方高增和南方隆元的基金经理助理、专户投资管理部总监助理、权益投资部副总监，现任权益投资部董事总经理；2007 年 12 月至 2010 年 10 月，担任南方基金企业年金和专户的投资经理。2011 年 6 月至 2017 年 7 月，

				任南方保本基金基金经理；2015 年 12 月至 2017 年 12 月，任南方瑞利保本基金经理；2015 年 5 月至 2018 年 6 月，任南方丰合保本基金基金经理；2010 年 12 月至今，任南方避险基金经理；2015 年 4 月至今，任南方利淘基金经理；2015 年 5 月至今，任南方利鑫基金经理；2016 年 1 月至今，任南方益和保本基金基金经理；2016 年 9 月至今，任南方安泰混合基金经理；2016 年 11 月至今，任南方安裕混合基金经理；2017 年 7 月至今，任南方安睿混合基金经理；2017 年 12 月至今，任南方瑞利混合基金经理；2018 年 1 月至今，任南方融尚再融资基金经理；2018 年 6 月至今，任南方新蓝筹混合、南方改革机遇、南方甄智混合基金经理。
--	--	--	--	---

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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、中国证监会和本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 4 次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及投资组合的投资策略需要所致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年三季度，中国经济各驱动因素均显现疲弱态势，市场面临的不确定性继续增加。国际局势微妙，中美贸易战持续加码，双方面临深刻的分歧。同时随着地产数据回落，具有后周期属性的消费增速也出现下行。三季度权益市场震荡下行。上证综指收于 2821，较上季度末下跌 0.9%；创业板指收于 1411，较上季度下跌 12.2%。

本基金原为南方丰合保本基金，二季度转型成为南方潜力新蓝筹基金。当前南方潜力新蓝筹基金仍处于转型期，股票仓位相对较低。在股票市场存在系统性风险的情况下，本基金采取稳健建仓的方式逐步提升股票仓位。行业选择方面，本基金着重配置稳定成长类行业；个股选择方面，本基金重点关注企业资本回报率、竞争优势、增长率、现金流和估值等因素，选择中小市值上市公司中业绩优良、发展稳定、红利优厚、品牌价值逐渐显现的上市公司股票。

4.5 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 1.1021 元，报告期内，份额净值增长率为-0.56%，同期业绩基准增长率为-6.38%。

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者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	51,823,505.80	22.03
	其中：股票	51,823,505.80	22.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	94,831,851.20	40.32
	其中：债券	94,831,851.20	40.32
	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	81,000,000.00	34.44
	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	5,067,704.94	2.15
8	其他资产	2,479,700.01	1.05
9	合计	235,202,761.95	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

金额单位：人民币元

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	34,385,265.00	14.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	484,785.00	0.21
F	批发和零售业	5,257,985.80	2.25
G	交通运输、仓储和邮政业	2,188,770.00	0.94
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	7,974,900.00	3.41
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,531,800.00	0.65
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	51,823,505.80	22.16

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	601009	南京银行	450,000	3,442,500.00	1.47
2	002511	中顺洁柔	330,000	2,722,500.00	1.16
3	601166	兴业银行	170,000	2,711,500.00	1.16
4	600056	中国医药	150,100	2,524,682.00	1.08
5	000651	格力电器	60,000	2,412,000.00	1.03
6	000786	北新建材	130,000	2,156,700.00	0.92
7	600176	中国巨石	190,000	2,015,900.00	0.86
8	601966	玲珑轮胎	120,000	1,884,000.00	0.81
9	600887	伊利股份	70,000	1,797,600.00	0.77
10	600511	国药股份	65,000	1,706,900.00	0.73

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	20,048,000.00	8.57
	其中：政策性金融债	20,048,000.00	8.57
4	企业债券	14,894,900.00	6.37
5	企业短期融资券	10,081,000.00	4.31
6	中期票据	10,141,000.00	4.34
7	可转债（可交换债）	13,951.20	0.01
8	同业存单	39,653,000.00	16.95
9	其他	-	-
10	合计	94,831,851.20	40.55

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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	180207	18 国开 07	200,000	20,048,000.00	8.57
2	136080	15 北汽 01	110,000	10,858,100.00	4.64
3	101355009	13 中铝业 MTN001	100,000	10,141,000.00	4.34
4	011800429	18 中建材 SCP006	100,000	10,081,000.00	4.31
5	111810326	18 兴业银行 CD326	100,000	9,914,000.00	4.24
5	111817145	18 光大银行 CD145	100,000	9,914,000.00	4.24

5	111820137	18 广发银行 CD137	100,000	9,914,000.00	4.24
---	-----------	------------------	---------	--------------	------

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

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

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名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

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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

报告期内基金投资的前十名证券除 18 广发银行 CD137（证券代码 111820137）、18 上海银行 CD210（证券代码 111816210）、18 兴业银行 CD326（证券代码 111810326）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。

1、18 广发银行 CD137（证券代码 111820137）

2017 年 12 月 8 日，银监会官网公告，依法查处广发银行违规担保案件，罚没金额高达 7.22 亿元。

2、18 上海银行 CD210（证券代码 111816210）

2018 年 1 月，因上海银行对底层资产为非标准化债权资产的投资投前尽职调查严重不审慎，部分理财资金用于增资和缴交土地出让金，与合同约定用途不一致，上海银监局对上海银行下达行政处罚，责令改正，并处罚款人民币 50 万元

3、18 兴业银行 CD326（证券代码 111810326）

银保监官网 2018 年 5 月 4 日公布了对兴业银行股份有限公司及其苏州分行相关人员的行政处罚决定书（银监罚决字〔2018〕1 号、2 号、3 号、4 号）。因 12 项违规，公司遭银监会罚款 5870 万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	100,622.29
2	应收证券清算款	657,943.22
3	应收股利	-
4	应收利息	1,615,847.36
5	应收申购款	105,287.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	2,479,700.01
---	----	--------------

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末投资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	249,685,780.08
报告期期间基金总申购份额	2,513,217.80
减：报告期期间基金总赎回份额	39,983,473.07
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	212,215,524.81

注：本基金转型日期为 2018 年 6 月 5 日，由原南方丰合保本混合型证券投资基金转型为南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金

§ 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

本报告期末，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

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金 2018 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>