南方沪港深价值主题灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期: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。

基金托管人招商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	南方沪港深价值主题灵活配置混合
基金主代码	001979
交易代码	001979
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月23日
报告期末基金份额总额	102,168,031.76份
投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1.资产配置策略 本基金对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,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。 2.股票投资策略 本基金动态界定“价值主题”相关主题,定性分析和定量分析相结合,评估分析组合股票的投资吸引力,构建与优化投资组合,并关注发掘“港股通”机制下的个股投资机会。 3.其他标的投资策略 在寻求债券、权证、股指期货等已知标的投资机会之外,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%＋上证国债指数收益率×40%
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。本基金可投资港股通标的股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
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“南方沪港深价值”。

§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	－8,041,158.26
2.本期利润	－3,413,470.63
3.加权平均基金份额本期利润	－0.0324
4.期末基金资产净值	88,519,187.51
5.期末基金份额净值	0.866

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	－2.91%	1.49%	－0.75%	0.82%	－2.16%	0.67%

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

§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		
毕凯	本基金基金经理	2018年6月8日	－	5年	美国埃默里大学工商管理专业（金融方向）硕士,注册金融分析师(CFA),具有基金从业资格。曾就职于赛灵思股份有限公司、翰亚投资基金有限公司、晨星资讯有限公司,历任高级分析师、绩效评价员、股票分析师。2015年6月加入南方基金,任职国际业务部研究员;2016年12月至2017年8月,任南方金砖基金经理助理;2017年8月至今,任南方香港优选、国企精明基金经理;2018年6月至今,任南方沪港深价值基金经理。

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年第三季度全球股市延续了第二季度的格局,美国经济持续高速增长,中国经济增速放缓拖累新兴市场经济整体走弱。根据Bloomberg的统计,2018年6月至2018年8月发达市场Markit制造业月度PMI分别为54.4、54.0和53.8,低于之前三个月均值,其中美国Markit制造业月度PMI分别为55.4、55.3和54.7,低于之前三个月均值;新兴市场Markit制造业月度PMI分别为51.2、51.0和50.8,低于之前三个月均值。美国经济一枝独秀,但PMI指数已经呈现边际走弱的趋势,美联储九月份再次加息25个基点,年内已加息三次,符合市场预期。从市场风格上来看,成长类个股持续跑赢价值类个股。按美元计价全收益口径计算,MSCI全球价值指数上涨4.22%,MSCI全球成长指数上涨5.94%。

报告期间,MSCI发达国家指数按美元计价上涨4.53%,MSCI新兴市场指数按美元计价下跌2.02%，恒生指数按港币计价下跌4.03%，黄金价格按美元计价下跌4.93%,十年期美国国债、十年期日本国债及十年期德国国债收益率分别上升20个基点、上升9个基点和上升17个基点。新兴市场方面,巴西圣保罗证交所指数按本币计价上涨9.04%,印度Nifty指数按本币计价上涨2.02%,俄罗斯MOEX指数按本币计价上涨7.81%。美元指数小幅上行,由94.47上升至95.13。

港股市场方面,2018年三季度恒生指数下跌4.03%，恒生国企指数下跌0.50%。从市值角度来看,港股出现普遍下跌的市场格局,恒生大型股指数下跌5.23%,恒生中型股指数下跌6.41%,恒生小型股指数下跌9.99%。根据Wind统计,2018年三季度港股通南下资金累计净卖出111亿元人民币,但其中九月份已经转为净流入68亿人民币。恒生AH股溢价指数于报告期内略有上升,由118.13点上扬至120.74点。恒生行业方面,能源、电讯和综合行业表现较好,分别跑赢恒生指数14.63%、12.53%和9.36%，表现较差的资讯科技、消费者服务和消费者制造板块分别落后12.99%、10.66%和 7.39%。

南方沪港深价值基金于2018年第二季度对投资管理人员进行了调整，在整体的投资配置上逐步增加港股配置,投资配置调整已于第二季度完成。在投资策略上以价值投资为导向,遵循自下而上为主的原则,在行业中精选盈利改善、估值水平合理的行业龙头公司,尤其关注公司的技术优势、发展战略、行业成长性以及产业政策的变化。基金在配置过程中也兼顾流动性、市场风格转换及调仓成本等其他相关因素,在弱势的市场格局中尽可能降低市场波动和风格转换带来的冲击,同时寻找错杀带来的投资机会,力争为投资者创造长期投资回报。

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0.866元,报告期内,份额净值增长率为－2.91%,同期业绩基准增长率为－0.75%。

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	80,260,161.93	90.10
	其中:股票	80,260,161.93	90.10
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	－	－
	其中:债券	－	－
	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	8,497,019.05	9.54
8	其他资产	326,163.54	0.37
9	合计	89,083,344.52	100.00

注：上表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额人民币79,921,761.93 元,占基金总资产比例89.72%。

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	－	－
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	338,400.00	0.38
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	－	－
J	金融业	－	－
K	房地产业	－	－
L	租赁和商务服务业	－	－
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	338,400.00	0.38

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
金融	32,604,456.96	36.83
科技	15,419,962.22	17.42
非必需消费	12,716,368.64	14.37
能源	7,479,223.02	8.45
材料	3,898,002.51	4.40
工业	2,680,327.70	3.03
必需消费品	2,083,017.64	2.35
公用事业	1,665,393.37	1.88
医疗保健	738,630.03	0.83
通讯	636,379.84	0.72
合计	79,921,761.93	90.29

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	00921	海信科龙电器股份有限公司	700,000	4,367,191.85	4.93
2	02018	瑞声科技控股有限公司	52,000	3,720,076.62	4.20
3	00966	中国太平保险控股有限公司	150,000	3,623,194.13	4.09
4	01171	兖州煤业股份有限公司	420,000	3,352,081.53	3.79
5	00939	中国建设银行股份有限公司	500,000	3,009,429.00	3.40
6	00763	中兴通讯股份有限公司	230,000	2,902,251.09	3.28
7	01658	中国邮政储蓄银行股份有限公司	650,000	2,819,799.78	3.19
8	00960	龙湖地产有限公司	150,000	2,666,248.50	3.01
9	03360	远东宏信有限公司	370,000	2,425,582.18	2.74
10	03908	中国国际金融股份有限公司	190,000	2,417,574.63	2.73

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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一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。

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	25,306.22
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	291,776.12
4	应收利息	1,614.46
5	应收申购款	7,466.74
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	326,163.54

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	146,094,999.53
报告期期间基金总申购份额	2,351,829.43
减:报告期期间基金总赎回份额	46,278,797.20
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	102,168,031.76

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180701－20180708	43,798,587.43	0.00	43,798,587.43	0.00	0.00%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过20%的基金份额持有人,在特定赎回比例及市场条件下,若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产,将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注:申购份额包含红利再投资和份额折算。

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、《南方沪港深价值主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

2、《南方沪港深价值主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

3、南方沪港深价值主题灵活配置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

南方绩优成长混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期: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。

基金托管人中国工商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	南方绩优成长混合
基金主代码	202003
交易代码	202003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月16日
报告期末基金份额总额	4,856,525,988.26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,根据对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡与精选，力争为投资者寻求超越基准的投资回报与长期稳健的资产增值。
投资策略	本基金的股票投资主要采用“自下而上”的策略,通过对上市公司基本面的深入研究，基于对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡,不仅重视公司的业绩与成长性,更注重公司的业绩与成长性的质量,精选中长期持续增长或未来阶段性高速增长、业绩质量优秀、且价值被低估的绩优成长股票作为主要投资对象。本基金的股票投资同时结合“自上而下”的行业分析,根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业，以最低的组合风险精选并确定最优质的股票组合。本基金将优先选择具有良好的行业增长空间,所处行业结构相对稳定，在产业链中处于优势地位或上下游运行态势好转,具有一定的垄断竞争优势,公司治理结构透明完善,管理水平领先的上市公司。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×上证国债指数
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	南方基金管理股份有限公司
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“南方绩优”。

§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	－227,589,730.92
2.本期利润	－341,886,953.51
3.加权平均基金份额本期利润	－0.0705
4.期末基金资产净值	4,620,953,775.83
5.期末基金份额净值	0.9515

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;

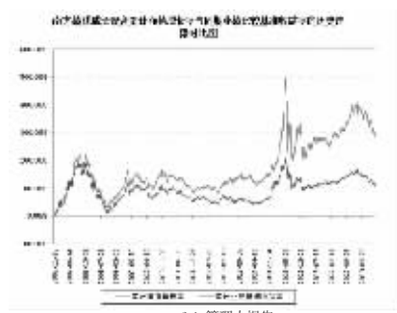
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	－6.91%	1.33%	－1.38%	1.09%	－5.53%	0.24%

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



§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		
史博	本基金基金经理	2011年2月17日	－	20年	特许金融分析师(CFA),硕士学历,具有基金从业资格。曾任职于博时基金管理有限公司、中国人寿资产管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司。2004年7月至2005年2月,任泰达周期基金经理;2007年7月至2009年5月任泰达首选基金经理;2008年8月至2009年9月任泰达市值基金经理;2009年4月至2009年9月任泰达品质基金经理。2009年10月加入南方基金,现任南方基金副总裁兼首席投资官（权益）,资产配置委员会主席,境内权益投资决策委员会主席,国际投资决策委员会主席、公募业务协同发展委员会副主席。2011年2月至今，任南方绩优基金经理;2014年2月至今,任南方新优享基金经理;2015年9月至今，任南方消费活力基金经理;2017年3月至今,任南方智慧混合基金经理;2018年5月至今,任南方瑞祥一年混合基金经理;2018年9月至今,任南方瑞合基金经理。
骆帅	本基金基金经理	2016年12月28日	－	9年	清华大学管理科学与工程专业硕士,具有基金从业资格。2009年7月加入南方基金,担任研究部研究员、高级研究员;2014年3月至2015年5月,任南方成份、南方安心基金经理助理;2015年5月至今,任南方高端装备基金经理;2015年6月至今,任南方价值、南方成长基金经理;2016年12月至今,任南方绩优基金经理;2018年8月至今,任南方共享经济混合基金经理。

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

三季度,国内与国外形势都面临一定压力。国内经济增速放缓,尤其是消费增速创多年新低,代表性的汽车消费有较大程度负增长,显示出居民在较高的杠杆水平下购买力受到制约。国外主要被中美贸易摩擦主导,美国政府在三季度不断对关税规模加码,并在其他方面对中国投资进行限制,影响了国内市场的风险偏好。双重压力下,国内权益市场表现疲弱,除了石化、金融等权重板块,大部分板块呈现下跌趋势。报告期内,本基金在权益仓位上处于中等水平,与上季度基本持平;债券仓位较低,以利率债为主。股票配置方面,泛消费仍然是核心配置,结构上更倾向与经济整体相关性较低的消费板块,如免税品和必需消费品等;增加了医药行业的配置,风格在较为均衡的基础上,偏向中盘成长。

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0.9515元,报告期内,份额净值增长率为－6.91%,同期业绩基准增长率为－1.38%。

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	3,775,188,747.15	79.79
	其中:股票	3,775,188,747.15	79.79
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	309,298,690.30	6.54
	其中:债券	309,298,690.30	6.54
	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	420,000,000.00	8.88
	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	218,841,646.98	4.63
8	其他资产	7,977,213.74	0.17
9	合计	4,731,306,298.17	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	2,443,869,834.24	52.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,438,924.00	1.31
E	建筑业	108,232.20	0.00
F	批发和零售业	47,636,134.10	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	41,215,390.00	0.89
H	住宿和餐饮业	15,210,000.00	0.33
I	信息传输、软件和信息技术服务业	92,989,956.10	2.01
J	金融业	561,863,588.40	12.16
K	房地产业	106,585,000.00	2.31
L	租赁和商务服务业	352,019,827.29	7.62
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	53,359,791.07	1.15
R	文化、体育和娱乐业	－	－
S	综合	－	－
	合计	3,775,188,747.15	81.70

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	601888	中国国旅	4,420,787	300,701,931.74	6.51
2	600036	招商银行	7,703,916	236,433,182.04	5.12
3	000661	长春高新	892,024	211,409,688.00	4.58
4	601318	中国平安	2,648,700	181,435,950.00	3.93
5	600745	闻泰科技	7,500,100	171,527,287.00	3.71
6	600519	贵州茅台	226,968	165,686,640.00	3.59
7	600309	万华化学	3,566,609	151,473,884.23	3.28
8	002236	大华股份	8,648,813	127,742,968.01	2.76
9	601166	兴业银行	7,981,450	127,304,127.50	2.75
10	601233	桐昆股份	5,999,915	98,638,602.60	2.13

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	301,261,000.00	6.52
	其中:政策性金融债	301,261,000.00	6.52
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)	8,037,690.30	0.17
8	同业存单	－	－
9	其他	－	－
10	合计	309,298,690.30	6.69

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	180209	18国开09	1,000,000	100,170,000.00	2.17
2	140323	14进出23	700,000	70,805,000.00	1.53
3	180301	18进出01	700,000	70,280,000.00	1.52
4	160415	16农发15	600,000	60,006,000.00	1.30
5	132004	15国盛EB	58,690	5,575,550.00	0.12

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

无。

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。

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	938,242.65
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	28,000.00
4	应收利息	5,539,951.43
5	应收申购款	1,471,019.66
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	7,977,213.74

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600745	闻泰科技	171,527,287.00	3.71	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,836,647,947.85
报告期期间基金总申购份额	104,818,932.81
减:报告期期间基金总赎回份额	84,940,892.40
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	4,856,525,988.26

§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、《南方绩优成长混合型证券投资基金基金合同》;

2、《南方绩优成长混合型证券投资基金托管协议》;

3、南方绩优成长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

南方积极配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期: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。

基金托管人中国工商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	南方积极配置混合(LOF)
场内简称	南方积配
基金主代码	160105
交