南方荣优鑫年享定期开放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:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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4日(最后运作日)止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方荣优鑫年享定期开放混合	
基金主代码	003807	
交易代码	003807	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3月24日	
报告期末基金份额总额	23,693,163.94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	1、资产配置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。2、股票投资策略本基金依托于基金管理人的投资研究平台,紧密跟踪中国经济结构转型的改革方向,努力探寻在调结构、促改革中具备长期价值增长潜力的上市公司。股票投资采用定量和定性分析相结合的策略。基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性,对组合进行优化,在合理风险水平下追求基金收益最大化,同时监控组合中证券的估值水平,在市场价格明显高于其内在合理价值时适时卖出证券。3、债券投资策略在选择债券品种时,首先根据宏观经济、资金面动向、发行人情况和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置;再次,在上述基础上利用债券定价技术选择个券,选择被价格低估的债券进行投资。本基金投资于中小企业私募债。由于中小企业私募债券整体流动性相对较差,且整体信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要点在具体的投资过程中,应采取更为谨慎的投资策略。本基金投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面,并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素,确定最终的投资决策。4、权证投资策略本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征,主要考虑运用的策略包括:价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。5、资产支持证券投资策略资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。6、开放期投资策略本基金以定期开放方式运作,即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内,基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化,因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性,以应对当时市场条件下的赎回要求,并降低资产的流动性风险,做好流动性管理。今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,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×15%+中债综合指数收益率×85%	
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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方荣优A	南方荣优C
下属分级基金的交易代码	003807	003808
报告期末下属分级基金的份额总额	23,596,159.14份	97,004.80份

注:1. 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"南方荣优"。

2.南方荣优已于2018年9月4日发布《南方荣优鑫年享定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,本基金于2018年9月5日进入清算流程。

§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4日)	
	南方荣优A	南方荣优C
1.本期已实现收益	118,613.46	408.73
2.本期利润	-122,571.44	-577.77
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0052	-0.0060
4.期末基金资产净值	25,439,654.91	103,970.98
5.期末基金份额净值	1.0781	1.0718

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

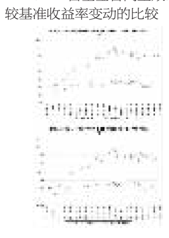
南方荣优A

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
2018.7.1-2018.9.4	-0.48%	0.12%	-0.19%	0.20%	-0.29%	-0.08%

南方荣优C

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
2018.7.1-2018.9.4	-0.56%	0.12%	-0.19%	0.20%	-0.37%	-0.08%

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		
李璇	本基金基金经理(已离任)	2017年3月24日	2018年7月27日	11年	女,清华大学金融学学士、硕士,注册金融分析师(CFA),具有基金从业资格。2007年加入南方基金,担任信用债高级分析师,现任固定收益投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员。2010年9月至2012年6月,任南方宝元基金经理;2012年12月至2014年9月,任南方安心基金经理;2015年12月至2017年2月,任南方润元基金经理;2013年7月至2017年9月,任南方稳利基金经理;2016年8月至2017年12月,任南方通利、南方荣冠基金经理;2016年8月至2018年2月,任南方丰元基金经理;2016年11月至2018年2月,任南方荣安基金经理;2017年1月至2018年7月,任南方和利基金经理;2017年3月至2018年7月,任南方荣优基金经理;2017年5月至2018年7月,任南方荣尊基金经理;2017年6月至2018年7月,任南方荣知基金经理;2017年7月至2018年7月,任南方荣年基金经理;2010年9月至今,任南方多利基金经理;2012年5月至今,任南方金利基金经理;2016年9月至今,任南方多元基金经理;2016年12月至今,任南方睿见混合基金经理;2017年1月至今,任南方宏元基金经理;2017年9月至今,任南方兴利基金经理;2018年7月至今,任南方配售基金经理。
李佳亮	本基金基金经理(已离任)	2017年4月13日	2018年9月4日	6年	美国南加州大学金融工程硕士,注册金融分析师(CFA),具有基金从业资格。2012年8月加入南方基金,任数量化投资部研究员;2015年5月至2016年8月,任量化投资经理助理;2017年4月至2018年9月,任南方荣优基金经理;2016年8月至今,任南方消费基金经理;2016年11月至今,任南方中证500增强基金经理;2016年12月至今,任南方绝对收益基金经理;2017年11月至今,任大数据100、大数据300、南方量化成长基金经理。

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

三季度经济表现较弱,1-8月工业增加值累计同比增长6.5%,1-8月固定资产投资累计同比增长5.3%,投资数据继续回落,其中基建跌幅较大,地产基本稳定,制造业韧性较强,1-8月社会消费品零售总额累计同比增长9.3%, 较二季度继续下滑。通胀方面,受食品价格尤其是猪肉价格的影响,三季度CPI持续上行,8月已回升至2.3%,而PPI在基数效应的影响下逐渐回落,8月已下行至4.1%。金融数据方面,M2增速依然偏低,7、8月分别同比增长8.5%和8.2%,信贷规模有明显回升,不过增量主要来自票据,社融受非标收缩影响表现相对较弱。

美联储9月如期加息,预计今年12月将再加息一次。欧央行维持利率不变,宣布10月开始缩减月度购债规模至150亿欧元,并将于年底结束购债。国内方面,央行未跟随加息,同时在国庆期间宣布降准1个百分点,考虑了置换的MLF后,净投放7500亿流动性。三季度美元指数上涨0.71%, 人民币对美元汇率中间价贬值2626个基点。三季度银行间隔夜、7天回购加权利率均值为2.35%、2.67%,分别较上季度下行38BP和72BP。

市场层面,三季度利率债短端下行幅度较大,长端震荡为主。1年国债、1年国开收益率分别下行16BP、59BP,10年国债、10年国开收益率分别上行14BP和下行5BP,利率债曲线显著陡峭化。信用债表现好于同期限国开债。三季度权益市场延续跌势,上证综指下跌0.92%,沪深300下跌2.05%,中小板和创业板大跌11.22%和12.16%。转债市场表现相对坚挺,二季度中证转债指数上涨2.68%。

投资运作上,由于组合已确定清盘,因此我们将组合中的股票及债券资产全部卖出。

预计四季度基本面难言企稳。利率债方面,汇率和通胀等因素依然对短期的走势构成压力,但内部经济下行压力较大,对外贸易形势也越发复杂化,利率下行的中长期条件依然成立。信用债方面,信用风险事件仍在不断出现,民企和城投平台的再融资压力不可忽视,对中低等级信用债需要谨慎择券,密切关注发行主体再融资能力变化,加强对持仓债券的跟踪和梳理,严防信用风险。权益市场方面,股市和转债估值处于历史底部区域,但市场情绪较为脆弱,需要自下而上挖掘个券。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A份额净值为1.0781元,报告期内,份额净值增长率为-0.48%,同期业绩基准增长率为-0.19%;本基金C份额净值为1.0718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-0.19%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

南方荣优已于2018年9月4日发布《南方荣优鑫年享定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,本基金于2018年9月5日进入清算流程并成立基金财产清算小组。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
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	15,771,707.41	61.02
8	其他资产	10,074,754.95	38.98
9	合计	25,846,462.36	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	68,580.76
2	应收证券清算款	10,000,698.63
3	应收股利	-
4	应收利息	5,475.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,074,754.95

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

项目	南方荣优A	南方荣优C
报告期期初基金份额总额	23,596,159.14	97,004.80
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	23,596,159.14	97,004.80

§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	20180701-20180904	23,538,055.55	0.00	0.00	23,538,055.55	99.35%
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、《南方荣优鑫年享定期开放混合型证券投资基金基金合同》;

2、《南方荣优鑫年享定期开放混合型证券投资基金托管协议》;

3、南方荣优鑫年享定期开放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

南方荣知定期开放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	南方荣知定期开放混合	
基金主代码	004443	
交易代码	004443	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年6月15日	
报告期末基金份额总额	45,067,081.62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及投资,力争实现基金资产的长期稳健增值。	
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×15%+中债综合指数收益率×85%	
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	
下属分级基金的基金简称	南方荣知定期开放混合A	南方荣知定期开放混合C
下属分级基金的交易代码	004443	004444
报告期末下属分级基金的份额总额	16,706,872.50份	28,360,209.12份

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"南方荣知"。

§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)	
	南方荣知定期开放混合A	南方荣知定期开放混合C
1.本期已实现收益	123,165.53	161,692.51
2.本期利润	295,689.79	449,251.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0176	0.0158
4.期末基金资产净值	17,771,994.36	29,933,780.20
5.期末基金份额净值	1.0638	1.0555

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

南方荣知定期开放混合A

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	1.67%	0.13%	0.23%	0.20%	1.44%	-0.07%

南方荣知定期开放混合C

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	1.52%	0.13%	0.23%	0.20%	1.29%	-0.07%

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		
金凌志	本基金基金经理	2017年7月28日	-	11年	中央财经大学经济学硕士,具有基金从业资格。曾先后就职于中国出口信用保险公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、长盛基金、嘉实基金,历任项目经理、信用分析师、基金经理助理、投资经理。2017年5月加入南方基金;2017年7月至今,任南方润元、南方荣知、南方纯元基金经理;2018年1月至今,任南方卓利基金经理;2018年2月至今,任南方和利基金经理;2018年3月至今,任南方乾利、南方浙利基金经理。
李璇	本基金基金经理(已离任)	2017年6月15日	2018年7月27日	11年	女,清华大学金融学学士、硕士,注册金融分析师(CFA),具有基金从业资格。2007年加入南方基金,担任信用债高级分析师,现任固定收益投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员。2010年9月至2012年6月,任南方宝元基金经理;2012年12月至2014年9月,任南方安心基金经理;2015年12月至2017年2月,任南方润元基金经理;2013年7月至2017年9月,任南方稳利基金经理;2016年8月至2017年12月,任南方通利、南方荣冠基金经理;2016年8月至2018年2月,任南方丰元基金经理;2016年11月至2018年2月,任南方荣安基金经理;2017年1月至2018年7月,任南方和利基金经理;2017年3月至2018年7月,任南方荣优基金经理;2017年5月至2018年7月,任南方荣尊基金经理;2017年6月至2018年7月,任南方荣知基金经理;2017年7月至2018年7月,任南方荣年基金经理;2010年9月至今,任南方多利基金经理;2012年5月至今,任南方金利基金经理;2016年9月至今,任南方多元基金经理;2016年12月至今,任南方睿见混合基金经理;2017年1月至今,任南方宏元基金经理;2017年9月至今,任南方兴利基金经理;2018年7月至今,任南方配售基金经理。

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

三季度经济表现较弱,1-8月工业增加值累计同比增长6.5%,1-8月固定资产投资累计同比增长5.3%,投资数据继续回落,其中基建跌幅较大,地产基本稳定,制造业韧性较强,1-8月社会消费品零售总额累计同比增长9.3%, 较二季度继续下滑。通胀方面,受食品价格尤其是猪肉价格的影响,三季度CPI持续上行,8月已回升至2.3%,而PPI在基数效应的影响下逐渐回落,8月已下行至4.1%。金融数据方面,M2增速依然偏低,7、8月分别同比增长8.5%和8.2%,信贷规模有明显回升,不过增量主要来自票据,社融受非标收缩影响表现相对较弱。

美联储9月如期加息,预计今年12月将再加息一次。欧央行维持利率不变,宣布10月开始缩减月度购债规模至150亿欧元,并将于年底结束购债。国内方面,央行未跟随加息,同时在国庆期间宣布降准1个百分点,考虑了置换的MLF后,净投放7500亿流动性。三季度美元指数上涨0.71%, 人民币对美元汇率中间价贬值2626个基点。三季度银行间隔夜、7天回购加权利率均值为2.35%、2.67%,分别较上季度下行38BP和72BP。

市场层面,三季度利率债短端下行幅度较大,长端震荡为主。1年国债、1年国开收益率分别下行16BP、59BP,10年国债、10年国开收益率分别上行14BP和下行5BP,利率债曲线显著陡峭化。信用债表现好于同期限国开债。

投资运作上,南方荣知三季度继续采用短端债券和长端利率债哑铃型操作方式,在三季度收益下行期间为组合贡献了较好的收益。四季度组合将维持原有操作策略,跟住市场中性久期,以低风险、稳收益为主要操作目标,争取在四季度继续为持有人提供较好的收益。股票方面,在贸易摩擦加剧和国内经济下行压力增大的背景下,组合进一步降低股票仓位,规避权益市场下跌风险。

预计四季度基本面难言企稳。利率债方面,汇率和通胀等因素依然对短期的走势构成压力,但内部经济下行压力较大,对外贸易形势也越发复杂化,利率下行的中长期条件依然成立。在外围市场不断下跌的情况下,权益市场情绪较差,难有趋势性机会,关注减税带来的机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A份额净值为1.0638元,报告期内,份额净值增长率为1.67%,同期业绩基准增长率为0.23%;本基金C份额净值为1.0555元,报告期内,份额净值增长率为1.52%,同期业绩基准增长率为0.23%。

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,本基金已出现连续六十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,具体时间范围如下:

2018年7月1日至2018年9月30日

基金管理人已根据基金合同及法律法规规定以及本基金实际情况,通过集中营销、向中国证监会报告并提出解决方案等方式积极处理。

§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	3,933,873.00	4.67
	其中:股票	3,933,873.00	4.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	76,445,691.85	90.77
	其中:债券	76,445,691.85	90.77
	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	2,431,059.34	2.89
8	其他资产	1,411,483.97	1.68
9	合计	84,222,108.16	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	1,547,545.00	3.24
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	434,808.00	0.91
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	245,100.00	0.51
J	金融业	580,900.00	1.22
K	房地产业	462,100.00	0.97
L	租赁和商务服务业	663,420.00	1.39
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	3,933,873.00	8.25

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	6,000	408,120.00	0.86
2	002507	涪陵榨菜	12,000	312,600.00	0.66
3	600036	招商银行	10,000	306,900.00	0.64
4	600519	贵州茅台	400	292,000.00	0.61
5	601318	中国平安	4,000	274,000.00	0.57
6	600887	伊利股份	10,000	256,800.00	0.54
7	002027	分众传媒	30,000	255,300.00	0.54
8	600845	宝信软件	10,000	245,100.00	0.51
9	600048	保利地产	20,000	243,400.00	0.51
10	002419	天虹股份	21,100	238,008.00	0.50

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	1,537,800.00	3.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	45,668,683.00	95.73
	其中:政策性金融债	44,661,983.00	93.62
4	企业债券	28,480,672.68	59.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	758,536.17	1.59
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	76,445,691.85	160.24

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	108602	国开1704	130,000	13,084,500.00	27.43
2	180409	18农发09	100,000	10,138,000.00	21.25
3	170412	17农发12	100,000	10,059,000.00	21.09
4	018006	国开1702	85,000	8,543,350.00	17.91
5	122201	12开滦01	41,110	4,147,999.00	8.69

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	74,512.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,336,971.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,411,483.97

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128022	众信转债	301,200.00	0.63
2	128035	大族转债	295,452.00	0.62
3	128019	久立转2	161,884.17	0.34

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

项目	南方荣知定期开放混合A	南方荣知定期开放混合C
报告期期初基金份额总额	17,566,883.67	28,960,264.94
报告期期间基金总申购份额	136,057.54	330,249.22
减:报告期期间基金总赎回份额	996,068.71	930,305.04
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	16,706,872.50	28,360,209.12

§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、《南方荣知定期开放混合型证券投资基金基金合同》;

2、《南方荣知定期开放混合型证券投资基金托管协议》;

3、南方荣知定期开放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

南方荣尊定期开放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	南方荣尊定期开放混合	
基金主代码	003938	
交易代码	003938	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年5月22日	
报告期末基金份额总额	122,521,928.56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及投资,力争实现基金资产的长期稳健增值。	
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×15%+中债综合指数(全价)收益率×85%	
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	
下属分级基金的基金简称	南方荣尊A	南方荣尊C
下属分级基金的交易代码	003938	003939
报告期末下属分级基金的份额总额	81,477,838.77份	41,044,089.79份

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"南方荣尊"。

§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)	
	南方荣尊A	南方荣尊C
1.本期已实现收益	845,771.08	360,006.26
2.本期利润	1,418,391.36	646,460.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0174	0.0158
4.期末基金资产净值	83,747,054.25	41,844,697.85
5.期末基金份额净值	1.0279	1.0195

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

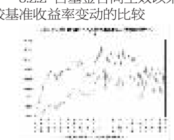
南方荣尊A

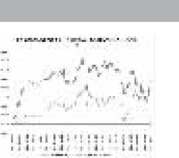
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.73%	0.09%	0.23%	0.20%	1.50%	-0.11%

南方荣尊C

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	1.56%	0.09%	0.23%	0.20%	1.33%	-0.11%

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





注:本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
何康	本基金基金经理	2018年5月17日	-	14年	西南财经大学金融学硕士,具有基金从业资格。曾先后就职于国海证券固定收益部、大成基金固定收益部、南方基金固定收益部、国海证券金融市场部,历任研究员、投资经理、基金经理、副总经理;2013年11月至2016年8月,任南方丰元、南方聚利基金经理;2014年4月至2016年8月,任南方通利基金经理;2015年2月至2016年8月,任南方双元基金经理。2017年6月加入南方基金;2017年8月至今,任南方双元、南方聚利基金经理;2017年9月至今,任南方稳利基金经理;2017年12月至今,任南方通利基金经理;2018年4月至今,任南方润利基金经理;2018年5月至今,任南方荣尊基金经理;2018年9月至今,任南方赢元基金经理。
李璇	本基金基金经理(已离任)	2017年5月22日	2018年7月27日	11年	女,清华大学金融学学士、硕士,注册金融分析师(CFA),具有基金从业资格。2007年加入南方基金,担任信用债高级分析师,现任固定收益投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员。2010年9月至2012年6月,任南方宝元基金经理;2012年12月至2014年9月,任南方安心基金经理;2015年12月至2017年2月,任南方润元基金经理;2013年7月至2017年9月,任南方稳利基金经理;2016年8月至2017年12月,任南方通利、南方荣冠基金经理;2016年8月至2018年2月,任南方丰元基金经理;2016年11月至2018年2月,任南方荣安基金经理;2017年1月至2018年7月,任南方和利基金经理;2017年3月至2018年7月,任南方荣优基金经理;2017年5月至2018年7月,任南方荣尊基金经理;2017年6月至2018年7月,任南方荣知基金经理;2017年7月至2018年7月,任南方荣年基金经理;2010年9月至今,任南方多利基金经理;2012年5月至今,任南方金利基金经理;2016年9月至今,任南方多元基金经理;2016年12月至今,任南方睿见混合基金经理;2017年1月至今,任南方宏元基金经理;2017年9月至今,任南方兴利基金经理;2018年7月至今,任南方配售基金经理。

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

三季度经济延续前期小幅回落走势,投资与消费指标继续下滑,地产相对稳定,制造业投资韧性略强。受食品类价格回升影响,CPI同比增速略有反弹,市场有一定通胀担忧。金融数据方面,信贷规模明显回升,增量主要来自票据冲量,社融以及M2增速依然偏低。央行延续前期相对宽松货币政策,未跟随美联储调升公开市场利率,在国庆期间降准1%,略超市场预期。银行间市场资金宽松,回购利率较上个季度下降明显。市场层面,三季度利率债短端下行幅度较大,长端震荡为主,利率债曲线陡峭化。信用债优于利率债,低评级信用债优于中高评级信用债。上证指数持续弱势,10月初跌破最近两年的低点。

四季度,内需下滑和贸易纠纷决定了生产和需求整体偏弱的格局,全年维持偏弱走势。物价数据继续小幅上行,通胀预期可控。政策方面,预计美联储将在四季度再次加息,中国央行将维持合理充裕流动性,积极推动银行系统发放贷款,但预计市场流动性充足,银行总体信用扩张有限。市场层面,中长期利率债收益率下降趋势明确,信用债收益率跟随下降,信用违约事件在年底会继续出现。股市在持续下跌后可能存在一定反弹,参与价值有限,市场信心与中长期预期恢复需要较长时间。

投资运作上,本基金延续二季度以来的加仓运作,在7月继续增持中长期利率债,8月以后组合基本保持稳定。我们在三季度一直维持较低的权益仓位。截至三季度末,组合久期较二季度有一定幅度提升,杠杆率基本稳定。展望未来,我们将在四季度维持组合杠杆率和久期的相对稳定。如果股市继续显著下跌,我们计划适当增加权益仓位,但总体依然控制在偏低仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A份额净值为1.0279元,报告期内,份额净值增长率为1.73%,同期业绩基准增长率为0.23%;本基金C份额净值为1.0195元,报告期内,份额净值增长率为1.56%,同期业绩基准增长率为0.23%。

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	3,629,437.00	1.72
	其中:股票	3,629,437.00	1.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	195,732,850.40	92.52
	其中:债券	195,732,850.40	92.52
	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	7,739,243.91	3.66
8	其他资产	4,457,001.50	2.11
9	合计	211,558,532.81	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	2,824,167.00	2.25
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	-	-
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	17,650.00	0.01
J	金融业	164,682.00	0.13
K	房地产业	622,938.00	0.50
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	3,629,437.00	2.89

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	000786	北新建材	42,500	705,075.00	0.56
2	001979	招商蛇口	33,200	620,508.00	0.49
3	600176	中国巨石	42,900	455,169.00	0.36
4	600887	伊利股份	17,600	451,968.00	0.36
5	000651	格力电器	10,500	422,100.00	0.34
6	600066	宇通客车	16,700	244,989.00	0.20
7	603816	顾家家居	4,700	234,060.00	0.19
8	000932	华菱钢铁	27,400	229,886.00	0.18
9	601939	建设银行	21,800	157,832.00	0.13
10	600519	贵州茅台	100	73,000.00	0.06

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	50,632,500.00	40.32
	其中:政策性金融债	50,632,500.00	40.32
4	企业债券	122,786,050.40	97.77
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	3,012,300.00	2.40
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	19,302,000.00	15.37
9	其他	-	-
10	合计	195,732,850.40	155.85

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	180205	18国开05	380,000	39,744,200.00	31.65
2	136301	16龙盛03	113,980	11,351,268.20	9.04
3	136236	16复药01	113,280	11,278,156.80	8.98
4	111814100	18江苏银行CD100	100,000	9,721,000.00	7.74
5	111892516	18南京银行CD031	100,000	9,581,000.00	7.63

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	48,801.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,408,200.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,457,001.50

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

项目	南方荣尊A	南方荣尊C
报告期期初基金份额总额	81,477,838.77	41,044,089.79
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	81,477,838.77	41,044,089.79

§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、《南方荣尊定期开放混合型证券投资基金基金合同》;

2、《南方荣尊定期开放混合型证券投资基金托管协议》;

3、南方荣尊定期开放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