南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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

2.1 基金基本情况

基金简称	南方深证成份ETF联接	
基金主代码	202017	
交易代码	202017	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年12月9日	
报告期末基金份额总额	360,680,189.08份	
投资目标	通过投资于深成ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。	
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,以深成ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资深成ETF。本基金并不参与深成ETF的管理。为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于深成ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。在正常市场情况下,本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。	
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金属股票基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
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	深成联接A	深成联接C
下属分级基金的交易代码	202017	004345
报告期末下属分级基金的份额总额	353,390,464.55份	7,289,724.53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“深成联接”。

2.2 目标基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009年12月4日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年2月2日
基金管理人名称	南方基金管理股份有限公司
基金托管人名称	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“深成ETF”

2.3 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证成份指数。 如果指数编制单位变更或终止深证成份指数的编制及发布,或深证成份指数由其他指数替代,或由于指数编制方法等重大变更导致深证成份指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,变更本基金的标的指数。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§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)	
	深成联接A	深成联接C
1.本期已实现收益	-1,082,486.22	-24,610.94
2.本期利润	-25,790,985.34	-378,771.49
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0739	-0.0601
4.期末基金资产净值	249,801,521.98	5,127,452.48
5.期末基金份额净值	0.7069	0.7034

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

深成联接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	-9.51%	1.36%	-9.90%	1.36%	0.39%	0.00%

深成联接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	-9.60%	1.36%	-9.90%	1.36%	0.30%	0.00%

注:本基金2017年2月20日发布公告,增加C类收费模式,原收费模式称为A类。

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2017年2月23日新增C类份额。

§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		
孙伟	本基金基金经理	2016年8月19日	-	8年	管理学学士,具有基金从业资格、金融分析师(CFA)资格、注册会计师(CPA)资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部,德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010年2月加入南方基金,历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员;2014年12月至2015年5月,担任南方恒生ETF的基金经理助理;2015年5月至2016年7月,任南方500工业ETF、南方500原材料ETF基金经理;2015年7月至今,任改革基金、高铁基金、500信息基金经理;2016年5月至今,任南方创业板ETF、南方创业板ETF联接基金经理;2016年8月至今,任500信息联接、深成ETF、南方深成基金经理;2017年3月至今,任南方金融证券ETF联接、南方中证全指证券ETF基金经理;2017年6月至今,任南方中证银行ETF、南方银行联接基金经理;2018年2月至今,任申万证券ETF、南方证券ETF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

深证成指本季度下跌10.43%。

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”等,将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平,并通过严格的风险管理流程,确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下:

(1)接受申购赎回所带来的股票仓位偏离,对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化;

(2)本基金大额换购目标ETF所带来的成份股权重偏离,对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对;

(3)报告期内指数成份股(包括调出指数成分股)的长期停牌,引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离。

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0.7069元,报告期内,份额净值增长率为-9.51%,同期业绩基准增长率为-9.90%;本基金C份额净值为0.7034元,报告期内,份额净值增长率为-9.60%,同期业绩基准增长率为-9.90%。

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	10,720,747.68	4.20
	其中:股票	10,720,747.68	4.20
2	基金投资	231,126,431.71	90.50
3	固定收益投资	10,060,000.00	3.94
	其中:债券	10,060,000.00	3.94
	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	3,126,453.70	1.22
8	其他资产	355,997.41	0.14
9	合计	255,389,630.50	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	247,691.40	0.10
B	采矿业	97,088.00	0.04
C	制造业	6,725,623.42	2.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	139,784.00	0.05
E	建筑业	116,846.90	0.05
F	批发和零售业	305,639.10	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	96,369.60	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,037,140.45	0.41
J	金融业	699,905.90	0.27
K	房地产业	587,078.40	0.23
L	租赁和商务服务业	214,876.36	0.08
M	科学研究和技术服务业	10,360.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	70,055.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	163,361.15	0.06
R	文化、体育和娱乐业	190,643.76	0.07
S	综合	18,286.24	0.01
	合计	10,720,747.68	4.21

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	000651	格力电器	9,400	377,880.00	0.15
2	000333	美的集团	8,200	344,974.00	0.14
3	000858	五粮液	3,600	244,620.00	0.10
4	002415	海康威视	6,887	197,932.38	0.08
5	000002	万科A	8,000	194,400.00	0.08
6	000001	平安银行	16,500	182,325.00	0.07
7	300498	温氏股份	7,520	174,614.40	0.07
8	000725	京东方A	51,400	161,910.00	0.06
9	002304	洋河股份	1,100	140,800.00	0.06
10	002027	分众传媒	15,236	129,658.36	0.05

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	10,060,000.00	3.95
	其中:政策性金融债	10,060,000.00	3.95
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	10,060,000.00	3.95

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	018005	国开1701	100,000	10,060,000.00	3.95

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	南方深成ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理股份有限公司	231,126,431.71	90.66

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

无。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11.3 本期国债期货投资评价

无。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.12.3 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	9,135.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	184,896.61
5	应收申购款	152,302.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	9,663.40
9	合计	355,997.41

5.12.4 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。

5.12.5 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	000333	美的集团	344,974.00	0.14	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	深成联接A	深成联接C
报告期期初基金份额总额	345,107,824.68	4,508,892.32
报告期期间基金总申购份额	16,678,276.60	7,189,480.12
减:报告期期间基金总赎回份额	8,395,636.73	4,408,647.91
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	353,390,464.55	7,289,724.53

§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、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》;

2、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

3、南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金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

南方盛元红利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	南方盛元红利混合
基金主代码	202009
交易代码	202009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年3月21日
报告期末基金份额总额	1,056,243,918.27份
投资目标	本基金为混合型基金,重点投资于具备持续良好盈利和分红能力、分红政策稳定的上市公司,以及高信息固定收益类投资品种,同时积极把握资本利得机会以拓展收益空间,力争为投资者谋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	90%×上证红利指数+10%×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,高于债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

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“南方盛元”;

2、本基金合同生效后一年内为封闭式,基金合同生效满一年后转为开放式,本基金已于2009年3月23日转为开放式。

§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	-55,509,502.67
2.本期利润	-47,602,260.37
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0450
4.期末基金资产净值	776,234,912.49
5.期末基金份额净值	0.735

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;

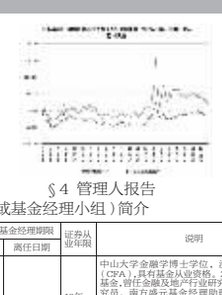
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-5.77%	1.44%	1.96%	1.02%	-7.73%	0.42%

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		
张旭	本基金基金经理	2012年11月23日	-	10年	中山大学金融学博士学位,注册金融分析师(CFA),具有基金从业资格。2008年加入南方基金,曾任金融及地产行业研究员、高级策略研究员、南方盛元基金经理助理;2012年3月至2014年12月,任南方消费基金经理;2012年11月至今,任南方盛元基金经理;2015年1月至今,任南方产业活力基金经理;2016年8月至今,任南方转型混合基金经理。

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年三季度国内经济增长有所放缓,固定资产投资低于预期,PMI从高位回落,消费数据也略显疲软。外部环境上,美国挑起的贸易摩擦升级,美联储持续加息,全球新兴市场外汇和股市普遍承压。在这些因素的作用下,A股经过二季度的大幅调整后三季度维持低位震荡,食品饮料等消费行业相对强势,TMT行业继续调整,上证综指下跌1%,创业板下跌12%。

报告期内,面对较为复杂的内部和外部环境,本基金一方面坚持持有具有长期竞争优势、抗风险能力较强的低估值龙头企业,优选与经济相关性较弱的消费类板块与稳增长政策受益的基建等板块。另一方面投资与国家战略转型方向相契合的科技型高成长公司。展望四季度,经济形势依然面临压力,美股回落给全球风险资产带来更高的不确定性,但中国经济强大的韧性、庞大的内需市场和经济转型期酝酿着投机机会,在当前股市估值低位更应加强研究,布局未来。

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0.735元,报告期内,份额净值增长率为-5.77%,同期业绩基准增长率为1.96%。

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	665,186,252.75	85.31
	其中:股票	665,186,252.75	85.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,085,000.00	6.42
	其中:债券	50,085,000.00	6.42
	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	36,085,565.71	4.63
8	其他资产	28,344,492.70	3.64
9	合计	779,701,311.16	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	4,907,790.00	0.63
B	采矿业	-	-
C	制造业	351,513,154.59	45.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	87,576,511.50	11.28
F	批发和零售业	13,685,604.32	1.76
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	143,743,792.34	18.52
J	金融业	45,853,400.00	5.91
K	房地产业	9,736,000.00	1.25
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	8,170,000.00	1.05
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	665,186,252.75	85.69

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	600068	葛洲坝	6,660,000	48,951,400.00	6.25
2	601186	中国铁建	3,500,010	39,025,111.50	5.03
3	300559	佳发教育	888,071	33,160,571.14	4.27
4	600372	中航高新	900,000	29,340,000.00	3.78
5	000661	长春高新	120,000	28,440,000.00	3.66
6	300571	平治信息	466,968	26,687,221.20	3.44
7	002511	中顺洁柔	3,112,451	25,677,720.75	3.31
8	300451	创业软件	1,380,000	24,219,000.00	3.12
9	300253	卫宁健康	1,500,000	21,630,000.00	2.79
10	002507	涪陵榨菜	799,965	20,839,088.25	2.68

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	50,085,000.00	6.45
	其中:政策性金融债	50,085,000.00	6.45
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	50,085,000.00	6.45

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	018006	国开1701	500,000	50,085,000.00	6.45

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	544,449.48
2	应收证券清算款	27,344,368.85
3	应收股利	-
4	应收利息	391,487.59
5	应收申购款	64,186.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,344,492.70

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	1,068,815,211.42
报告期期间基金总申购份额	17,007,057.08
减:报告期期间基金总赎回份额	19,578,350.23
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	1,056,243,918.27

§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、《南方盛元红利混合型证券投资基金基金合同》;

2、《南方盛元红利混合型证券投资基金托管协议》;

3、南方盛元红利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

南方双元债券型证券投资基金

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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	南方双元债券
基金主代码	000997
交易代码	000997
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月10日
报告期末基金份额总额	55,960,839.96份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将密切关注经济运行趋势,把握领先指标,预测未来走势,深入分析国家推行的财政与货币政策对未来宏观经济运行以及投资环境的影响。本基金将根据宏观经济,基准利率水平,预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平,结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析,做出最佳的资产配置及风险控制。
业绩比