

南方卓享绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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
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...

§ 2 基金基本情况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (南方卓享绝对收益策略定期开放混合, 000032, etc.)

投资目标
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

投资策略
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率\*20%+中债综合指数收益率\*80%

风险收益特征
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

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,可称为“南方卓享绝对收益”。

3.1 主要财务指标

§ 3 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

Table with 2 columns: Item (本报告期末, 本报告期末比上年末) and Value (196,113.21, -10.01%)

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;

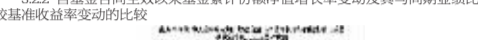
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

Table with 2 columns: Period (过去三个月) and Values (0.64%, 0.16%, 0.62%, 0.01%, -0.13%, 0.16%)

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

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...

§ 2 基金基本情况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (南方卓享绝对收益策略定期开放混合, 000032, etc.)

投资目标
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

投资策略
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率\*20%+中债综合指数收益率\*80%

风险收益特征
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

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,可称为“南方卓享绝对收益”。

3.1 主要财务指标

§ 3 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

Table with 2 columns: Item (本报告期末, 本报告期末比上年末) and Value (196,113.21, -10.01%)

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;

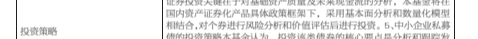
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

Table with 2 columns: Period (过去三个月) and Values (0.64%, 0.16%, 0.62%, 0.01%, -0.13%, 0.16%)

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

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...

§ 2 基金基本情况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (南方卓享绝对收益策略定期开放混合, 000032, etc.)

投资目标
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

投资策略
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率\*20%+中债综合指数收益率\*80%

风险收益特征
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

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,可称为“南方卓享绝对收益”。

3.1 主要财务指标

§ 3 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

Table with 2 columns: Item (本报告期末, 本报告期末比上年末) and Value (196,113.21, -10.01%)

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

Table with 2 columns: Period (过去三个月) and Values (0.64%, 0.16%, 0.62%, 0.01%, -0.13%, 0.16%)

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

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...

§ 2 基金基本情况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (南方卓享绝对收益策略定期开放混合, 000032, etc.)

投资目标
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

投资策略
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率\*20%+中债综合指数收益率\*80%

风险收益特征
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

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,可称为“南方卓享绝对收益”。

3.1 主要财务指标

§ 3 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

Table with 2 columns: Item (本报告期末, 本报告期末比上年末) and Value (196,113.21, -10.01%)

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;

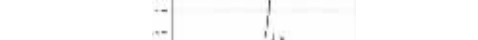
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

Table with 2 columns: Period (过去三个月) and Values (0.64%, 0.16%, 0.62%, 0.01%, -0.13%, 0.16%)

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

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...

南方卓享绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

Table with 4 columns: Name, Position, Start Date, End Date, and Remarks (基金经理:王健, 2016年12月30日, 13年, etc.)

注:1.本基金首任基金经理的任职日期为基金合同生效日,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 管理人对于报告期内本基金运作遵守守信情况的说明

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》等相关法律法规、中国证监会和基金合同的规定,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。

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金额占该证券当日成交量的5%的交易次数为0次,是由于投资组合接受投资者申购后被动增仓仓位以及投资组合的投资策略调整所致。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
本基金本季度投资主要通过仓位和操作及交易所申购赎回等管理实现。量化对冲部分投资由于市场波动降低,股指期货的政策限制导致股指期货现货的选择范围不大,模型的超额收益受到了不小的影响,所以本基金仓位上仍以较低仓位为主。但我们也注意到,由于政策限制导致股指期货的流动性较差以及期货现货水的情况在基差的好转中。在对冲之外,我们也进行了交易所申购赎回等现金的操作,给基金贡献了部分收益。在后续的投资过程中,随着市场的逐步常态化,预期本基金的操作将逐渐回归常态,以量化对冲为主,希望可以给投资者提供稳定的回报。

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1.0160元,报告期内,份额净值增长率为0.64%,同期业绩基准增长率为0.82%。

§ 2 基金基本情况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (南方卓享绝对收益策略定期开放混合, 000032, etc.)

投资目标
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

投资策略
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率\*20%+中债综合指数收益率\*80%

风险收益特征
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

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,可称为“南方卓享绝对收益”。

3.1 主要财务指标

§ 3 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

Table with 2 columns: Item (本报告期末, 本报告期末比上年末) and Value (196,113.21, -10.01%)

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;

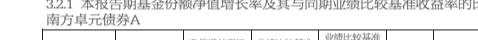
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

Table with 2 columns: Period (过去三个月) and Values (0.64%, 0.16%, 0.62%, 0.01%, -0.13%, 0.16%)

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

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...

§ 2 基金基本情况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (南方卓享绝对收益策略定期开放混合, 000032, etc.)

投资目标
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

投资策略
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率\*20%+中债综合指数收益率\*80%

风险收益特征
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

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,可称为“南方卓享绝对收益”。

3.1 主要财务指标

§ 3 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

Table with 2 columns: Item (本报告期末, 本报告期末比上年末) and Value (196,113.21, -10.01%)

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

Table with 2 columns: Period (过去三个月) and Values (0.64%, 0.16%, 0.62%, 0.01%, -0.13%, 0.16%)

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

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...

§ 2 基金基本情况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (南方卓享绝对收益策略定期开放混合, 000032, etc.)

投资目标
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

投资策略
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率\*20%+中债综合指数收益率\*80%

风险收益特征
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

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,可称为“南方卓享绝对收益”。

3.1 主要财务指标

§ 3 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

Table with 2 columns: Item (本报告期末, 本报告期末比上年末) and Value (196,113.21, -10.01%)

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;

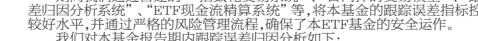
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

Table with 2 columns: Period (过去三个月) and Values (0.64%, 0.16%, 0.62%, 0.01%, -0.13%, 0.16%)

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

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...

§ 2 基金基本情况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (南方卓享绝对收益策略定期开放混合, 000032, etc.)

投资目标
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

投资策略
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率\*20%+中债综合指数收益率\*80%

风险收益特征
本基金为绝对收益策略基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

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,可称为“南方卓享绝对收益”。

南方卓元债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

Table with 4 columns: Name, Position, Start Date, End Date, and Remarks (基金经理:王健, 2016年12月30日, 13年, etc.)

注:1.本基金首任基金经理的任职日期为基金合同生效日,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 管理人对于报告期内本基金运作遵守守信情况的说明

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》等相关法律法规、中国证监会和基金合同的规定,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。

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金额占该证券当日成交量的5%的交易次数为0次,是由于投资组合接受投资者申购后被动增仓仓位以及投资组合的投资策略调整所致。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
本基金本季度投资主要通过仓位和操作及交易所申购赎回等管理实现。量化对冲部分投资由于市场波动降低,股指期货的政策限制导致股指期货现货的选择范围不大,模型的超额收益受到了不小的影响,所以本基金仓位上仍以较低仓位为主。但我们也注意到,由于政策限制导致股指期货的流动性较差以及期货现货水的情况在基差的好转中。在对冲之外,我们也进行了交易所申购赎回等现金的操作,给基金贡献了部分收益。在后续的投资过程中,随着市场的逐步常态化,预期本基金的操作将逐渐回归常态,以量化对冲为主,希望可以给投资者提供稳定的回报。

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1.0160元,报告期内,份额净值增长率为0.64%,同期业绩基准增长率为0.82%。

§ 2 基金基本情况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (南方卓元债券, 000032, etc.)

投资目标
本基金为债券型证券投资基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

投资策略
本基金为债券型证券投资基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率\*20%+中债综合指数收益率\*80%

风险收益特征
本基金为债券型证券投资基金,追求绝对收益,力争实现基金资产的长期稳定增值...

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,可称为“南方卓元债券”。

3.1 主要财务指标

§ 3 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

Table with 2 columns: Item (本报告期末, 本报告期末比上年末) and Value (196,113.21, -10.01%)

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;

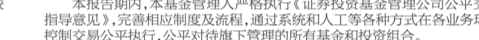
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

Table with 2 columns: Period (过去三个月) and Values (0.64%, 0.16%, 0.62%, 0.01%, -0.13%, 0.16%)

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

基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管