

# 信息披露

## 南方聚利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）

### 2017年第三季度报告

“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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《证券投资基金管理人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  
本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析  
三季度经济数据整体保持稳定,工业增加值、固定资产投资、房地产投资略有回落,基建继续保持较高增速,制造业投资保持低位,物价数据保持平稳,PPI保持高位运行,CPI增速较低,央行继续保持中性货币政策,资金面中性略紧,债券市场方面,收益率震荡未见,收益率曲线略有平坦化,信用债整体表现略好于利率债,但房地产行业信用债收益率受负面传闻影响出现明显上行。

四季度,预计宏观经济将继续维持前期的稳定走势,通胀压力不大,货币政策继续保持中性,资金面中性略紧,部分针对资管行业的监管政策有望在四季度落地,市场方面,预计收益率曲线波动幅度不大,信用债风险可控,利率债和信用债均具有一定的配置价值。

投资运作上,本基金在三季度主要操作以微调为主,持本基金保持稳定,组合久期中性略低,以中高等级信用债为持仓主体,展望未来,我们将继续保持组合总体稳定,根据市场的震荡走势适度进行波段性操作。

本报告期内南方聚利A基金净值增长率为0.69%,同期业绩比较基准增长率为0.61%;南方聚利C基金净值增长率为0.69%,同期业绩比较基准增长率为0.63%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明  
无。

#### 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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	--	--
	其中:股票	--	--
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	1,061,170,637.00	92.22
	其中:债券	1,034,278,637.00	89.98
	资产支持证券	26,896,000.00	--
4	贵金属投资	--	--
5	金融衍生品投资	--	--
6	买入返售金融资产	16,800,140.00	1.46
7	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
8	银行存款和拆借金融资产合计	46,168,464.00	4.02
9	其他资产	23,906,208.56	2.10
10	合计	1,139,797,448.56	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	7,016,538.00	0.62
B	医药生物	67,410,349.00	5.93
C	制造业	542,794.64	0.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,560,616.00	0.67
E	建筑业	2,742,300.06	0.24
F	批发和零售业	26,571.91	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	1,066,470.00	0.93
I	金融业	18,240,430.70	1.63
J	房地产业	31,489,106.69	2.79
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	2,475,030.00	0.22
N	综合	142,947,016.06	12.67
合计		142,947,016.06	12.67

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
注:本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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	601166	兴业银行	227,200	3,028,288.00	1.41
2	600960	华鲁恒升	102,700	3,002,200.00	1.40
3	000002	万科A	197,700	3,077,120.00	1.38
4	000726	东岳集团	364,200	3,002,400.00	1.37
5	600309	万邦化学	82,320	3,469,788.00	1.25
6	000778	运盛颐泰	542,300	3,425,000.00	1.23
7	000489	铜峰电子	567,048	3,203,656.38	1.10
8	600688	上海石化	280,800	3,224,880.00	1.16
9	601553	华信国际	307,000	3,219,210.00	1.16
10	000948	宁波南汇	121,000	3,107,677.00	1.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合  
注: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序的前五名债券投资明细

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	139549	13国债03	500,000	43.99
2	125230	12国债03	460,000	40.49
3	01913002	14央行票据01913002	300,000	26.18
4	011793004	17国债03004	300,000	26.14
5	011793001	17国债03001	300,000	26.14
6	17989144	17国债14	300,000	26.18

5.6 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资产支持证券投资明细

注: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

注: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序的前五名权证投资明细

注: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

5.11 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

5.11.2 声明本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。

5.11.3 其他资产构成

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有受限情况。

5.11.6 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.11.7 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.11.8 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11.10 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国债期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.11 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商品期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有商品期货。

5.11.12 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期权投资明细

注:本基金本报告期末未持有期权。

5.11.13 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.11.14 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.15 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.11.16 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.11.17 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.18 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股指期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11.19 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国债期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.20 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商品期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有商品期货。

5.11.21 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期权投资明细

注:本基金本报告期末未持有期权。

5.11.22 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.11.23 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.24 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股指期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11.25 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国债期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.26 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商品期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有商品期货。

5.11.27 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期权投资明细

注:本基金本报告期末未持有期权。

5.11.28 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.11.29 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.30 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股指期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11.31 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国债期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.32 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商品期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有商品期货。

5.11.33 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期权投资明细

注:本基金本报告期末未持有期权。

5.11.34 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.11.35 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.36 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股指期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11.37 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国债期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.38 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商品期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有商品期货。

5.11.39 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期权投资明细

注:本基金本报告期末未持有期权。

5.11.40 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.11.41 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.42 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股指期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11.43 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国债期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.44 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商品期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有商品期货。

5.11.45 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期权投资明细

注:本基金本报告期末未持有期权。

5.11.46 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.11.47 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.48 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股指期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11.49 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国债期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.50 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商品期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有商品期货。

5.11.51 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期权投资明细

注:本基金本报告期末未持有期权。

5.11.52 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.11.53 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.54 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股指期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11.55 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国债期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.56 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商品期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有商品期货。

5.11.57 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期权投资明细

注:本基金本报告期末未持有期权。

5.11.58 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.11.59 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.60 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股指期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11.61 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国债期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.62 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商品期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有商品期货。

5.11.63 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期权投资明细

注:本基金本报告期末未持有期权。

5.11.64 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.11.65 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.66 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股指期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11.67 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国债期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.68 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商品期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有商品期货。

5.11.69 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期权投资明细

注:本基金本报告期末未持有期权。

5.11.70 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.11.71 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.72 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股指期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11.73 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国债期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.74 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商品期货投资明细