

信息披露disclosure

南方量化成长股票型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年第三季度报告

年份	资产规模
2015	~100
2016	~150
2017	~250

4.1 基金管理人(或基金基金经理) 4.2 基金管理人报告

姓名	职务	任本基金基金经理期限	证券从业年限	说明
曹伟	基金经理	2015年6月20日	9年	<p>北京大学智能科学系硕士,具有基金从业资格。2006年加入南方基金,历任信息技术部系统研发研究员、量化投资部高级研究员、量化投资部基金经理助理,2014年12月至2016年4月,任南方恒生ETF基金经理,2015年4月至2016年4月,任南方中证500-LOF基金经理,2015年7月至2016年7月,任改革基金、国策基金、南500食品饮料基金经理,2016年10月至今,任大成100基金基金经理,2015年10月至2017年10月,任大成成长基金基金经理,2017年10月至今,任南方量化混合基金基金经理。</p>

注:1、对基金的聘任基础信息,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公开渠道确定的解聘日期;对基金的聘任信息,“任职日期”和“离任日期”分别根据公开渠道确定的聘任日期和离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人投资本基金基金投资策略和运作情况的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、中国证监会和《南方量化成长股票型证券投资基金基金合同》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,基金运作整体合规合法,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期间,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,公平对待所有管理下的基金投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期间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5%的交易笔数为0支,未由于投资组合导致投资者申购后赎回导致仓位以及资产型基金仓位调整情况。

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

报告期内,本基金投资策略以量化行为模型选股为主,充分借助南方大数据量化平台的成果,有效整合了包括多因子选股模型在内的量化数据模型,根据最优化模型进行投资组合,另外,采用合同期限的1/3作为基金流动性需求,也有助于提升基金流动性。经过三季度调整仓位,仓位高低已有不同的投资机会,后续产品运作将在坚持原有投资理念基础上,完善和改进模型,力争获取超越市场表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金资产净值为1.213元;报告期内,基金份额净值增长率为4.57%,同期业绩基准增长率为0.84%。

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	842,940,561.93	83.04
	其中:股票	842,940,561.93	83.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
4	银行存款	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	25,000,000.00	2.46
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存贷款和结算备付金合计	121,963,320.99	12.01
8	其他资产	26,211,601.99	2.48
9	合计	1,015,666,474.89	100.00

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	1,329,316.00	0.13
B	采矿业	12,619,744.64	1.19
C	制造业	546,472,897.78	56.08
D	电力、热力、燃气及生产供应业	30,270,528.89	3.00
E	建筑业	26,585,008.00	2.58
F	批发和零售业	33,093,336.18	3.28
G	交通运输、仓储和邮政业	22,568,269.91	2.23
H	住宿和餐饮业	1,982,042.00	0.20
I	信息技术、软件和信息技术服务业	67,236,708.94	6.67
J	金融业	43,146,026.00	4.28
K	房地产业	4,266,141.76	0.42
L	租赁和商务服务业	12,037,584.62	1.19
M	科学研究和技术服务业	4,632,394.27	0.46
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	115,289.89	0.01
R	文化、体育和娱乐业	16,631,423.99	1.65
S	综合	1,797,852.00	0.18
	合计	842,940,561.93	83.04

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	600259	广安股份	1,174,600	29,928,800.00	2.97
2	000402	和邦泰	1,284,300	12,971,430.00	1.29
3	600036	招商银行	500,000	12,776,000.00	1.27
4	000717	绝味食品	1,260,346	10,751,052.4	1.06
5	300129	华胜天成	1,342,148	10,367,696.64	1.02
6	000897	新野纺织	1,677,560	10,081,776.00	1.00
7	600623	中天科技	589,750	8,413,237.50	0.83
8	600705	永鼎股份	864,000	7,871,040.00	0.78
9	000719	中航资本	268,800	7,767,360.00	0.77
10	000491	成发集团	528,790	7,750,092.00	0.77

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	600259	广安股份	1,174,600	29,928,800.00	2.97
2	000402	和邦泰	1,284,300	12,971,430.00	1.29
3	600036	招商银行	500,000	12,776,000.00	1.27
4	000717	绝味食品	1,260,346	10,751,052.4	1.06
5	300129	华胜天成	1,342,148	10,367,696.64	1.02
6	000897	新野纺织	1,677,560	10,081,776.00	1.00
7	600623	中天科技	589,750	8,413,237.50	0.83
8	600705	永鼎股份	864,000	7,871,040.00	0.78
9	000719	中航资本	268,800	7,767,360.00	0.77
10	000491	成发集团	528,790	7,750,092.00	0.77

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1710	IC1710	56	72,464,640.00	-578,360.00	-

注:本基金本报告期末未持有港股投资股票。

其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

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没有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。

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,还应对外披露的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有出现超出基金合同规定的备选股票库。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	14,439,110.34
2	应收证券清算款	8,319,763.69
3	应收股利	-
4	应收利息	-66,446.00
5	应收申购款	2,018,142.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,211,601.97

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

注:本基金本报告期末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

报告期末基金份额总额	967,008,227.76
报告期内基金份额总额申购	91,946,760.64
减:报告期内基金份额总额赎回	217,842,662.74
报告期内基金份额总额申购	-
报告期内基金份额总额赎回	-
报告期末基金份额总额	831,111,377.68

§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

注:基金管理人未持有本基金基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:基金管理人未持有本基金基金份额。

§8 备查文件目录

1.南方量化成长股票型证券投资基金合同

2.南方量化成长股票型证券投资基金托管协议

3.南方量化成长股票型证券投资基金2017年第三季度报告原文

8.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福安一路六号免税商务大厦31-33层。

8.3 查阅方式

网站:http://www.nfnd.com

价值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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

5.11.2 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

注:本基金本报告期末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

报告期末基金份额总额	967,008,227.76
报告期内基金份额总额申购	91,946,760.64
减:报告期内基金份额总额赎回	217,842,662.74
报告期内基金份额总额申购	-
报告期内基金份额总额赎回	-
报告期末基金份额总额	831,111,377.68

§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

注:基金管理人未持有本基金基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:基金管理人未持有本基金基金份额。

§8 备查文件目录

1.南方量化成长股票型证券投资基金合同

2.南方量化成长股票型证券投资基金托管协议

3.南方量化成长股票型证券投资基金2017年第三季度报告原文

8.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福安一路六号免税商务大厦31-33层。

8.3 查阅方式

网站:http://www.nfnd.com

价值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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

5.11.2 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

注:本基金本报告期末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

报告期末基金份额总额	967,008,227.76
报告期内基金份额总额申购	91,946,760.64
减:报告期内基金份额总额赎回	217,842,662.74
报告期内基金份额总额申购	-
报告期内基金份额总额赎回	-
报告期末基金份额总额	831,111,377.68

§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

注:基金管理人未持有本基金基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:基金管理人未持有本基金基金份额。

§8 备查文件目录

1.南方量化成长股票型证券投资基金合同

2.南方量化成长股票型证券投资基金托管协议

3.南方量化成长股票型证券投资基金2017年第三季度报告原文

8.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福安一路六号免税商务大厦31-33层。

8.3 查阅方式

网站:http://www.nfnd.com

价值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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

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没有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,还应对外披露的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有出现超出基金合同规定的备选股票库。

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,还应对外披露的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有出现超出基金合同规定的备选股票库。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	89,223.54
2	应收证券清算款	882,424.20
3	应收利息	-
4	应收股利	10,278,066.00
5	应收申购款	20,736.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,271,279.12

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

注:本基金本报告期末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

报告期末基金份额总额	967,008,227.76
报告期内基金份额总额申购	91,946,760.64
减:报告期内基金份额总额赎回	217,842,662.74
报告期内基金份额总额申购	-
报告期内基金份额总额赎回	-
报告期末基金份额总额	831,111,377.68

§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

注:基金管理人未持有本基金基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:基金管理人未持有本基金基金份额。

§8 备查文件目录

1.《南方量化成长股票型证券投资基金基金合同》

2.《南方量化成长股票型证券投资基金托管协议》

3.南方量化成长股票型证券投资基金2017年第三季度报告原文

9.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福安一路六号免税商务大厦31-33层。

9.3 查阅方式

网站:http://www.nfnd.com

价值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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

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没有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。

本基金投资的前十名股票没有出现超出基金合同规定的备选股票库。

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,还应对外披露的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有出现超出基金合同规定的备选股票库。

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	89,223.54
2	应收证券清算款	882,424.20
3	应收利息	-
4	应收股利	10,278,066.00
5	应收申购款	20,736.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,271,279.12

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

注:本基金本报告期末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

报告期末基金份额总额	967,008,227.76
报告期内基金份额总额申购	91,946,760.64
减:报告期内基金份额总额赎回	217,842,662.74
报告期内基金份额总额申购	-
报告期内基金份额总额赎回	-
报告期末基金份额总额	831,111,377.68

§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

注:基金管理人未持有本基金基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:基金管理人未持有本基金基金份额。

§8 备查文件目录

1.《南方量化成长股票型证券投资基金基金合同》

2.《南方量化成长股票型证券投资基金托管协议》

3.南方量化成长股票型证券投资基金2017年第三季度报告原文

9.2 存放地点