

南方荣光灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事和高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2017年10月23日复核了本报告期内的财务指标、净值表现、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。投资人投资于基金，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报吿期自2017年1月1日起至2017年9月30日止。
§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称 南方荣光灵活配置混合
基金代码 002015

基金运作方式 灵活配置开放式
基金合同生效日 2016年11月19日

报告期末基金资产总额 510,313,667.32份

投资目标 在严格控制风险的前提下，通过专业化研究分析及投资，力争实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准 沪深300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 南方荣光灵活配置混合A
南方荣光灵活配置混合C

下属分级基金的交易代码 002015
002016

基金总资产 510,313,667.32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“南方荣光”。

§ 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
报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日

南方荣光灵活配置混合 A 南方荣光灵活配置混合C

1.本期已实现收益 10,046,723.52
2.本期利润 14,692,756.82
3.加权平均基金份额本期利润 0.0283
4.期末基金资产净值 566,111,440.02
5.期末基金份额净值 1.0691

注:1.本公司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)扣减相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
2.扣除非经常性损益后,本期利润与本期已实现收益基本一致;
3.加权平均基金份额本期利润是指按以下公式计算得出:
加权平均基金份额本期利润=(本期已实现收益+本期利润)/期末基金资产净值;

4.期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总数;

5.基金净值表现

3.2.1 本期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

南方荣光灵活配置混合A

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三个月 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较

南方荣光灵活配置混合A

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三年 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

注:1.对基金的基金份额,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此前的非前任基金经理,“任职日期”和“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.扣除非经常性损益后,本期利润与本期已实现收益基本一致;

3.加权平均基金份额净值包括持有人认购或申购基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于净资产数;

4.基金净值表现

3.2.1 本期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

南方荣光灵活配置混合C

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三个月 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较

南方荣光灵活配置混合C

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三个月 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

注:1.对基金的基金份额,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此前的非前任基金经理,“任职日期”和“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.扣除非经常性损益后,本期利润与本期已实现收益基本一致;

3.加权平均基金份额净值包括持有人认购或申购基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于净资产数;

4.基金净值表现

3.2.1 本期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

南方荣光灵活配置混合A

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三个月 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较

南方荣光灵活配置混合C

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三个月 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

注:1.对基金的基金份额,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此前的非前任基金经理,“任职日期”和“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.扣除非经常性损益后,本期利润与本期已实现收益基本一致;

3.加权平均基金份额净值包括持有人认购或申购基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于净资产数;

4.基金净值表现

3.2.1 本期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

南方荣光灵活配置混合A

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三个月 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较

南方荣光灵活配置混合C

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三个月 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

注:1.对基金的基金份额,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此前的非前任基金经理,“任职日期”和“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.扣除非经常性损益后,本期利润与本期已实现收益基本一致;

3.加权平均基金份额净值包括持有人认购或申购基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于净资产数;

4.基金净值表现

3.2.1 本期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

南方荣光灵活配置混合A

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三个月 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较

南方荣光灵活配置混合C

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三个月 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

注:1.对基金的基金份额,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此前的非前任基金经理,“任职日期”和“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.扣除非经常性损益后,本期利润与本期已实现收益基本一致;

3.加权平均基金份额净值包括持有人认购或申购基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于净资产数;

4.基金净值表现

3.2.1 本期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

南方荣光灵活配置混合A

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三个月 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较

南方荣光灵活配置混合C

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三个月 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

注:1.对基金的基金份额,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此前的非前任基金经理,“任职日期”和“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.扣除非经常性损益后,本期利润与本期已实现收益基本一致;

3.加权平均基金份额净值包括持有人认购或申购基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于净资产数;

4.基金净值表现

3.2.1 本期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

南方荣光灵活配置混合A

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三个月 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较

南方荣光灵活配置混合C

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三个月 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

注:1.对基金的基金份额,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此前的非前任基金经理,“任职日期”和“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.扣除非经常性损益后,本期利润与本期已实现收益基本一致;

3.加权平均基金份额净值包括持有人认购或申购基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于净资产数;

4.基金净值表现

3.2.1 本期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

南方荣光灵活配置混合A

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三个月 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较

南方荣光灵活配置混合C

阶段 净值增长 长期平均 收益比较高(%)
标准差(%)
基准收益率
差额(%)
①-③ ②-④

过去三个月 2.69% 0.16% 0.80% 0.12% 1.89% 0.04%

注:1.对基金的基金份额,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此前的非前任基金经理,“任职日期”和“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.扣除非经常性损益后,本期利润与本期已实现收益基本一致;

3.加权平均基金份额净值包括持有人认购或申购基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于净资产数;

</div