

南方荣毅定期开放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

基金管理人的董事局及基金经理对报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的准确性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人对本基金报告书所载内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，或其内容的准确性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金，但不保证基金一定盈利，利害关系人承诺以其真实未来表现、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。

本报告期中财务数据未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 南方荣毅定期开放混合

基金主代码 002031

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2016年07月03日

报告期末基金份额总额 99,314,906.28份

投资目标 本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。

投资策略 本基金通过行业分析和综合评价方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估行业的系统性风险及各行业的相对投资价值，据此进行合理的资产配置。本基金将定期进行定期资产配置调整，在保持总体固定收益类资产比例的基础上，力求投资组合的动态优化。此外，本基金将根据宏观经济形势变化适时进行定期资产配置调整，适时地出售持有的股票、债券等资产，降低风险。

业绩比较基准 深证300指数收益率×10%+中债综合指数收益率×90%

风险收益特征 本基金为混合型基金，其长期平均风险预期收益水平低于股票型基金，高于货币基金，投资风格偏稳健。

基金管理人 南方基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息显示场下份额，可简称为“南方荣毅”。

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日

1.本期已实现收益 10,426,710.40

2.本期利润 2,014,942.97

3.加权平均基金份额净值 0.0909

4.期末基金份额净值 0.996,641.32

5.期末可供分配基金份额总额 1,006

注:1.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)和股息收益，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.所有财务指标指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其他财务指标。

3.基金净值表现

3.21 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

过去三个月 1.62% 0.10% 0.32% 0.06% 1.30% 0.04%

3.22 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

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

过去三年 2.06% 0.12% 0.56% 0.09% 1.70% 0.03%

注:1. 对基金的任期内收益，“最近一日”为报告期间，“最近一日”为根据报告期间的最后一个自然日确定的最近一日的基金净值，“最近一年”和“最近三年”分别为报告期的最后一个自然日确定的最近一年和最近三年的基金净值。

2. 本基金从成立之日起进入封闭期，本基金在封闭期内不接受申购赎回申请，敬请投资者注意。

3. 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金，但不保证基金一定盈利。

4.3 管理人报告

4.3.1 公平交易专项说明

本基金报告期内未发生不公平交易行为。

本基金报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金公平交易制度指导意见》，完善公平交易制度及流程，通过系统和人工等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 异常交易专项说明

本基金报告期内未发生异常交易行为。

本基金报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金公平交易制度指导意见》，完善公平交易制度及流程，通过系统和人工等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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金的资产配置和运作分析

报告期内，本基金在严格控制风险的前提下，通过资产配置和仓位调整，把握市场机会，追求资产的长期稳定增值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金在严格控制风险的前提下，通过资产配置和仓位调整，把握市场机会，追求资产的长期稳定增值。

4.5 报告期内基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息显示场下份额，可简称为“南方荣毅”。

4.6 管理人报告

4.6.1 本期已实现收益

20,231,007.93 5,794.77

4.6.2 本期利润

17,342,474.17 4,904.22

4.6.3 加权平均基金份额本期利润

0.0233 0.0222

4.6.4 期末基金资产净值

779,600,232.61 232,110.06

4.6.5 期末可供分配基金份额余额

10,934 10,912

注:1.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)和股息收益。

2.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.加权平均基金份额本期利润

0.0233

4.期末基金资产净值

232,006,061.76份

注:1.本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息显示场下份额，可简称为“南方荣毅”。

4.7 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日

南方荣毅A 5,794.77

南方荣毅C 4,904.22

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息显示场下份额，可简称为“南方荣毅”。

4.8 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日

南方荣毅A 5,794.77

南方荣毅C 4,904.22

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息显示场下份额，可简称为“南方荣毅”。

4.9 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日

南方荣毅A 5,794.77

南方荣毅C 4,904.22

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息显示场下份额，可简称为“南方荣毅”。

4.10 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日

南方荣毅A 5,794.77

南方荣毅C 4,904.22

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息显示场下份额，可简称为“南方荣毅”。

4.11 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日

南方荣毅A 5,794.77

南方荣毅C 4,904.22

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息显示场下份额，可简称为“南方荣毅”。

4.12 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日

南方荣毅A 5,794.77

南方荣毅C 4,904.22

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息显示场下份额，可简称为“南方荣毅”。

4.13 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日

南方荣毅A 5,794.77

南方荣毅C 4,904.22

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息显示场下份额，可简称为“南方荣毅”。

4.14 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日

南方荣毅A 5,794.77

南方荣毅C 4,904.22

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息显示场下份额，可简称为“南方荣毅”。

4.15 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日

南方荣毅A 5,794.77

南方荣毅C 4,904.22

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息显示场下份额，可简称为“南方荣毅”。

4.16 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日

南方荣毅A 5,794.77

南方荣毅C 4,904.22

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息显示场下份额，可简称为“南方荣毅”。

4.17 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日

南方荣毅A 5,794.77

南方荣毅C 4,904.22

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息显示场下份额，可简称为“南方荣毅”。

4.18 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日

南方荣毅A 5,794.77

南方荣毅C 4,904.22

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息显示场下份额，可简称为“南方荣毅”。

4.19 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2017年07月01日 - 2017年09月30日

南方荣毅A 5,794.77

南方荣毅C 4,90