

## 南方荣尊定期开放混合型证券投资基金

## 2017年第三季度报告

南方基金管理有限公司

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、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。投资有风险，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。

本报告期为2017年7月1日起至2017年9月30日止。

### §2 基金基本情况

基金名称	南方荣尊定期开放混合
基金主代码	000808
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年07月23日
报告期内基金份额总额	641,320,700.00份
报告期末	2017年9月30日
投资目标	本基金力争在严格控制风险的前提下，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过定性定量相结合的方法分析宏观经济运行和证券市场趋势，并在此基础上制定和调整资产配置、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争实现基金投资目标。此外，本基金还将通过仓位调节与不同期限的资产配置来调整投资组合的风险收益，适时调整资产配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×10%+中债综合指数收益率×90%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于货币型基金，属于证券投资基金中较低风险品种。
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	南方荣尊A	南方荣尊C
下属分级基金的代码	000808	000809
报告期末下属分级基金的份额	149,102,060.00份	492,217,311.00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“南方荣尊”。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年7月1日至2017年9月30日)	单位:人民币元
	南方荣尊A	南方荣尊C
1.本期已实现收益	-1,470,537.47	-2,071,567.21
2.本期利润	1,494,494.34	-200,306.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0077	-0.0002
4.期末基金份额净值	1.02,201.39	0.99,361.29
期末基金份额净值增长率	1.017	1.005

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)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；

2.所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。

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

阶段	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	0.07%	0.03%	0.03%	0.03%	0.02%	-0.01%

注：①.本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。



图：本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

基金管理人：南方基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司  
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、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

### §2 基金资产概况

基金名称	南方瑞利保本混合
基金主代码	000500
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月25日
报告期内基金份额总额	1,090,622,423.03份
投资目标	本基金力争在严格控制风险的前提下，严格控制仓位，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用积极的投资组合管理策略（Conservative-Proportion Portfolio Management, CPPM）来实施本基金的投资目标。资产配置策略包括确定不同大类资产配置比例、资产配置比例调整、本基金资产配置策略不能从宏观综合研判市场趋势出发，本基金资产配置比例调整不能基于对宏观经济、行业、个股的短期判断，本基金资产配置比例调整不能基于对宏观经济、行业、个股的短期判断，本基金资产配置比例调整不能基于对宏观经济、行业、个股的短期判断。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：人民币定期存款利率（税后）+1.05%。
风险收益特征	本基金为保本混合型证券投资基金，属于证券投资基金中较低风险品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于货币型基金，属于证券投资基金中一般风险品种。
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
基金销售人	深圳市福田福田街道福华一路六号免税商务大厦31—33层

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“南方瑞利保本”。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年7月1日至2017年9月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	10,491,038.48	
2.本期利润	11,033,441.41	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0100	
4.期末基金份额净值	1,190,428,247.99	
期末基金份额净值增长率	1.077	

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)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损益。

2.所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。

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

阶段	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	0.04%	0.07%	0.03%	0.01%	0.21%	0.06%

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

图：本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

基金管理人：南方基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司  
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、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。投资有风险，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

### §2 基金基本情况

基金名称	南方荣利保本混合
基金主代码	000500
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年07月23日
报告期内基金份额总额	641,320,700.00份
报告期末	2017年9月30日
投资目标	本基金力争在严格控制风险的前提下，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	1.资产配置策略 本基金通过定性定量相结合的方法分析宏观经济运行和证券市场趋势，并在此基础上制定和调整资产配置、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争实现基金投资目标。此外，本基金还将通过仓位调节与不同期限的资产配置来调整投资组合的风险收益，适时调整资产配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×10%+中债综合指数收益率×90%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于货币型基金，属于证券投资基金中较低风险品种。
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	南方荣利保本A	南方荣利保本C
下属分级基金的代码	000500	000501
报告期末下属分级基金的份额	149,102,060.00份	77,047,426.31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“南方荣利”。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年7月1日至2017年9月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-2,493,423.27	-1,270,550.04
2.本期利润	-2,493,423.27	-1,270,550.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0094	-0.0097
4.期末基金份额净值	0.974,794,723.02	98,300,422.64
期末基金份额净值增长率	1.136	1.172

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)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；

2.所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。

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

阶段	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	-0.62%	0.03%	0.03%	0.04%	-0.03%	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动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图：本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

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

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、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。投资有风险，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

### §2 基金基本情况

基金名称	南方荣利保本混合
基金主代码	000500
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年07月23日
报告期内基金份额总额	641,320,700.00份
报告期末	2017年9月30日
投资目标	本基金力争在严格控制风险的前提下，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	1.资产配置策略 本基金通过定性定量相结合的方法分析宏观经济运行和证券市场趋势，并在此基础上制定和调整资产配置、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争实现基金投资目标。此外，本基金还将通过仓位调节与不同期限的资产配置来调整投资组合的风险收益，适时调整资产配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×10%+中债综合指数收益率×90%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于货币型基金，属于证券投资基金中较低风险品种。
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	南方荣利保本A	南方荣利保本C
下属分级基金的代码	000500	000501
报告期末下属分级基金的份额	149,102,060.00份	77,047,426.31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“南方荣利”。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年7月1日至2017年9月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-1,470,537.47	-2,071,567.21
2.本期利润	1,494,494.34	-200,306.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0077	-0.0002
4.期末基金份额净值	1.02,201.39	0.99,361.29
期末基金份额净值增长率	1.017	1.005

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)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；

2.所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。

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

阶段	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	0.07%	0.03%	0.03%	0.03%	0.02%	-0.01%

注：1.本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。

图：本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

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

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、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。投资有风险，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

### §2 基金资产概况

基金名称	南方瑞利保本混合
基金主代码	000500
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月25日
报告期内基金份额总额	1,090,622,423.03份
投资目标	本基金力争在严格控制风险的前提下，严格控制仓位，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用积极的投资组合管理策略（Conservative-Proportion Portfolio Management, CPPM）来实施本基金的投资目标。资产配置策略包括确定不同大类资产配置比例、资产配置比例调整、本基金资产配置策略不能从宏观综合研判市场趋势出发，本基金资产配置比例调整不能基于对宏观经济、行业、个股的短期判断，本基金资产配置比例调整不能基于对宏观经济、行业、个股的短期判断，本基金资产配置比例调整不能基于对宏观经济、行业、个股的短期判断。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：人民币定期存款利率（税后）+1.05%。
风险收益特征	本基金为保本混合型证券投资基金，属于证券投资基金中较低风险品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于货币型基金，属于证券投资基金中一般风险品种。
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
基金销售人	深圳市福田福田街道福华一路六号免税商务大厦31—33层

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“南方瑞利保本”。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年7月1日至2017年9月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	10,491,038.48	
2.本期利润	11,033,441.41	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0100	
4.期末基金份额净值	1,190,428,247.99	
期末基金份额净值增长率	1.077	

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)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损益。

2.所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。

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

阶段	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	0.04%	0.07%	0.03%	0.01%	0.21%	0.06%

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

图：本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

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

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、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。投资有风险，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

### §2 基金基本情况

基金名称	南方荣利保本混合
基金主代码	000500
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年07月23日
报告期内基金份额总额	641,320,700.00份
报告期末	2017年9月30日
投资目标	本基金力争在严格控制风险的前提下，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	1.资产配置策略 本基金通过定性定量相结合的方法分析宏观经济运行和证券市场趋势，并在此基础上制定和调整资产配置、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争实现基金投资目标。此外，本基金还将通过仓位调节与不同期限的资产配置来调整投资组合的风险收益，适时调整资产配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×10%+中债综合指数收益率×90%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于货币型基金，属于证券投资基金中较低风险品种。
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	南方荣利保本A	南方荣利保本C
下属分级基金的代码	000500	000501
报告期末下属分级基金的份额	149,102,060.00份	77,047,426.31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“南方荣利”。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年7月1日至2017年9月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-2,493,423.27	-1,270,550.04
2.本期利润	-2,493,423.27	-1,270,550.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0094	-0.0097
4.期末基金份额净值	0.974,794,723.02	98,300,422.64
期末基金份额净值增长率	1.136	1.172

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)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；

2.所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。

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

阶段	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	-0.62%	0.03%	0.03%	0.04%	-0.03%	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动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图：本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