

## 南方顺康保本混合型证券投资基金

### 2017年第三季度报告

于很多超额的个股而言,政策底已经逐步表明,监管层规范减持对于上市公司重要股东增持证券增多,均有利于超越跌落的反弹。

我们在配置上将继续立足于基本盘,选取价格具备性价比,可以超越越跌的品种。当前主要从如下4个方面的收益机制选股:(1)估值与成长性相匹配,PEG小于1的或成长;(2)市值低于市值价格,存在被摊薄的可能;(3)价格低于增增或重要股东增持成本;(4)高股息率。在此基础上,积极布局受益改革政策,消费升级以及行业基本面向好的超越跌跌及个股。

4.4.2 报告期内基金的投资表现和资产配置情况:本基金份额净值1.0635元,本报告期份额净值增长率为0.96%,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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	171,076,960.54	79.4
2	固定收益	171,076,960.54	79.4
3	衍生金融资产	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收利息	-	-
6	其他资产	54,000,000.00	25.1
7	负债及负债余额	-	-
8	净资产	1,192,525,521.35	54.90
9	合计	24,360,641.04	1.16
10	合计	2,163,317,174.00	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

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	-	4,076,762.18	0.32
B 采矿业	-	77,652,283.19	6.22
C 制造业	-	4,583,381.09	0.21
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	7,362,032.93	0.57
E 建筑业	-	1,391,100.91	0.07
F 批发和零售业	-	7,889,544.00	0.57
G 交通运输、仓储和邮政业	-	29,386,000.00	1.27
H 住宿和餐饮业	-	13,616,917.29	0.90
I 信息传输、软件和信息技术服务业	-	11,063,718.72	0.61
M 其他行业	-	37,527,000.00	0.61
N 本币、外国货币及贵金属	-	3,071,147.26	0.17
O 应收款项、预付款项及其他流动资产	-	-	-
P 投资性房地产	-	-	-
Q 无形资产、开发支出、商誉及其他非流动资产	-	115,280,000.00	0.91
R 文化、体育和娱乐业	-	14,219,000.00	0.20
S 综合	-	4,096,370.00	0.26
T 合计	-	171,076,960.54	79.4

5.2.2 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

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

## 南方天天利货币市场基金

### 2017年第三季度报告

行,望在继续跟踪。

政策层面,政策组合显示内部对通胀和加息问题上仍存在分歧,但年内或仍有一次加息,市场的预期有所修正。当前货币政策的取向是稳增长,央行在政策传导上仍保持对普惠金融领域定向降准,但不理解对大蓝筹。如果市场加杠杆行为再度兴起,则可能触发央行收紧的考虑。

4.4.2 报告期内基金的投资表现和资产配置情况:本基金份额净值1.0877元,本报告期份额净值增长率为1.08%,同期业绩比较基准收益率为0.3465%;8级基金净值收益率为1.40%,同期业绩比较基准收益率为0.3465%;8级基金净值收益率为0.3465%;8级基金净值收益率为0.3465%。

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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	21,216,527,397.91	48.38
2	固定收益	21,216,527,397.91	48.38
3	衍生金融资产	-	-
4	买入返售金融资产	5,264,813,768.03	6.33
5	其他资产	-	-
6	负债及负债余额	-	-
7	净资产	36,489,030,586.82	61.89
8	合计	34,222,261,029.84	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

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	-	20,036,948.09	3.83
B 采矿业	-	20,036,948.09	3.83
C 制造业	-	20,036,948.09	3.83
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	20,036,948.09	3.83
E 建筑业	-	20,036,948.09	3.83
F 批发和零售业	-	20,036,948.09	3.83
G 交通运输、仓储和邮政业	-	20,036,948.09	3.83
H 住宿和餐饮业	-	20,036,948.09	3.83
I 信息传输、软件和信息技术服务业	-	20,036,948.09	3.83
M 其他行业	-	20,036,948.09	3.83
N 本币、外国货币及贵金属	-	20,036,948.09	3.83
O 应收款项、预付款项及其他流动资产	-	20,036,948.09	3.83
P 投资性房地产	-	20,036,948.09	3.83
Q 无形资产、开发支出、商誉及其他非流动资产	-	20,036,948.09	3.83
R 文化、体育和娱乐业	-	20,036,948.09	3.83
S 综合	-	20,036,948.09	3.83
T 合计	-	20,036,948.09	3.83

5.2.2 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

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.4 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流通股股票投资。

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十名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

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十名衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

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十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

注:本基金本报告期末未持有流通股股票投资。

5.3 报告期末未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	000015	华银国际	880,300	8,159,464.00	0.38
2	002829	汇金股份	728,000	7,011,304.00	0.31
3	002028	中化国际	280,100	6,539,327.44	0.32
4	000563	中农国际	275,300	6,427,170.00	0.29
5	002004	华信国际	709,900	6,096,422.00	0.28
6	000000	平安银行	543,300	6,082,062.00	0.28
7	003466	九鼎投资	273,300	5,969,077.00	0.28
8	002151	慧眼科技	602,700	5,896,466.00	0.27
9	000000	浦发银行	127,200	5,767,873.00	0.27
10	000027	华力国际	252,300	5,766,120.00	0.27

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	63,812,400.00	2.26
2	央行票据	-	-
3	金融债	49,000,000.00	2.22
4	企业债	49,000,000.00	2.22
5	可转债(可分离)	161,461,000.00	2.22
6	其他资产	20,000,000.00	0.94
7	合计	389,380,000.00	0.92
8	其他资产	-	-
9	合计	720,742,000.00	2.62

5.5 报告期末未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	债券名称	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1719164001	17国债附息01001	1,500,000	150,200,000.00	6.06
2	041603001	16国债附息03001	1,000,000	100,400,000.00	4.07
3	1719163001	17国债附息03001	800,000	80,140,000.00	3.73
4	122229	12国债附息01	710,000	71,000,000.00	3.25
5	1719164103	17国债附息01003	700,000	70,160,000.00	3.26

5.6 报告期末未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 报告期末未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 报告期末未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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金参与股指期货投资应符合基金合同约定的保本策略和投资目标。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,主要采用流动性好、交易活跃的头期合约,通过对现货和期货市场的运行跟踪研究,结合股指期货的流动性寻求其合理估值水平,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 股指期货组合报告附注

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

5.11.2 声明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

5.11.3 声明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

5.11.4 声明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

5.11.5 声明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

5.11.6 声明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

5.11.7 声明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

5.11.8 声明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

5.11.9 声明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

5.11.10 声明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

5.11.11 声明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

5.11.12 声明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

5.11.13 声明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

5.11.14 声明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

5.11.15 声明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

5.11.16 声明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

5.11.17 声明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

5.11.18 声明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

5.11.19 声明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

5.11.20 声明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

5.11.21 声明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

5.11.22 声明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

5.11.23 声明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

5.11.24 声明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

5.11.25 声明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

5.11.26 声明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

5.11.27 声明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

5.11.28 声明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