

## 南方稳健成长证券投资基金

## 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。  
本报告书财务资料未经审计。  
本报告书自2017年7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  
基金名称:南方稳健成长基金  
基金代码:200201  
基金运作方式:契约型开放式  
基金合同生效日:2001年09月21日  
报告期末基金资产总额:1,026,901,364.07元  
投资目标:本基金为稳健成长基金,在控制风险并保持基金资产组合良好流动性的前提下,力争为投资者获得长期稳定的资本增值。  
本基金主要投资于具有良好流动性的证券,包括国内依法公开发行的股票、债券、权证、货币市场工具、基金、基金专户、银行存款、国债、短期融资券、企业债、可转换债券、可分离交易的可转债、可交换债券、资产支持证券、权证、资产支持票据、国债期货、股票期权等金融工具。  
投资策略:本基金主要投资于具有良好流动性的证券,包括国内依法公开发行的股票、债券、权证、货币市场工具、基金、基金专户、银行存款、国债、短期融资券、企业债、可转换债券、可分离交易的可转债、可交换债券、资产支持证券、权证、资产支持票据、国债期货、股票期权等金融工具。  
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

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“南方稳健”。

## § 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

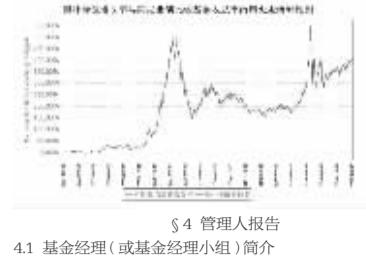
主要财务指标		报告期(2017年07月01日 - 2017年09月30日)
1.本期已实现收益		73,546,872.30
2.本期利润		44,361,271.36
3.期末可供分配基金份额利润		0.0284
4.期末基金资产净值		2,110,706,761.74(2)
5.期末基金份额净值		1.0596

注:1.本期已实现收益指本基金本期利息收入、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 本基金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	2.12%	0.05%	0.00%	0.00%	2.12%	0.05%

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



§ 4 管理人报告

## 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理时间		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
应峰	本基金基金经理	2016年01月23日	-	10年	北京大学光华管理学院金融学硕士,具有基金从业资格,2006年7月加入南方基金管理有限公司,任基金经理,2012年11月至今任基金经理,2016年1月至今任基金经理,2016年3月至今任基金经理,2017年1月至今任基金经理,2017年4月至今任基金经理,2017年7月至今任基金经理,2017年9月至今任基金经理,2017年10月至今任基金经理。

注:1.对基金的首任基金经理,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;对之后的非首任基金经理,“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.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会《南方稳健成长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。本基金报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 公平交易专项说明

## 4.3.1 公平交易制度的执行情况

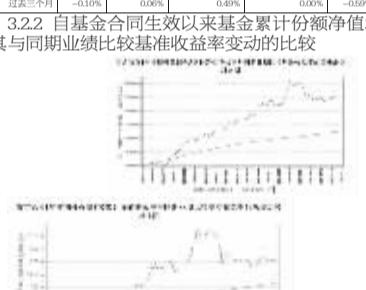
本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金运作管理办法》和公司《公平交易制度》,未发现本基金存在不公平交易行为。

本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。

本报告期内财务资料未经审计。

## 4.3.2 基金产品概况

4.3.3 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



注:本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。

本报告期内财务资料未经审计。

## 4.3.4 公平交易专项说明

## 4.3.5 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金运作管理办法》和公司《公平交易制度》,未发现本基金存在不公平交易行为。

本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。

本报告期内财务资料未经审计。

## 4.3.6 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



注:1.对基金的首任基金经理,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;对之后的非首任基金经理,“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.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.2 基金净值表现  
3.2.1 本基金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	0.00%	0.06%	0.47%	0.00%	-0.47%	0.00%

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

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司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,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

## 4.3 异常交易行为的专项说明

本基金在报告期内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的5%的交易次数为3次,是由于投资组合直接接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数型基金成份股调整所致。

## 4.4 报告期内基金的销售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

2017年上半年宏观经济运行良好,尤其是二季度继续超出预期;三季度宏观经济数据尚可,符合预期;房地产投资受宏观调控冲击不大,二三线库存速度加快,全国房地产投资增速超预期增长;全球经济同步复苏,我国出口数据继续好于预期。2017年三季度我国资本市场继续稳步推进,尤其是以钢铁、煤炭为代表的周期股出现了大幅上涨的超级行情。创业板也只出现企稳,出现了较为明显回升。本基金今年以来继续保持较高仓位,以绝对收益为投资理念,主要投资了具有较好安全边际的白酒、金融、家电和汽车板块。在主题投资上,本基金主要投资于新能源汽车配置,主要理由是涨幅过大。本基金将继续采取自下而上的选股策略,以价值投资为理念,争取获得较好的绝对收益。

## 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017年三季度沪深300指数增长率为4.63%,基金净值增长率为2.12%。

## 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)	占基金总资产的比例(%)	报告期末基金资产组合情况	
				其中:股票	债券
1	权益投资	1,600,000,203.04	69.92%	1,600,000,203.04	0.00%
2	固定收益投资	699,000,000.00	30.08%	699,000,000.00	100.00%
3	银行存款	1,000,000.00	0.01%	1,000,000.00	100.00%
4	其他资产	1,000,000.00	0.01%	1,000,000.00	100.00%
5	负债合计	1,000,000.00	0.01%	1,000,000.00	100.00%
6	报告期末基金资产净值	2,109,000,203.04	100.00%	2,109,000,203.04	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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境外股票投资组合

5.2.4 报告期末按行业分类的其他类型股票投资组合

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.2.6 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股票投资明细

5.2.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.2.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.2.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

5.2.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票期权投资明细

5.2.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名商品期货投资明细

5.2.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名外汇投资明细

5.2.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资明细

5.2.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.2.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

5.2.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名卖出回购金融资产

5.2.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

5.2.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产

5.2.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名负债

5.2.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名所有者权益(或份额)变动情况

5.2.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前