

南方盛元红利混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 7 月 21 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 2023 年 7 月 19 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。

本报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南方盛元红利混合
基金主代码	202009
前端交易代码	202009
后端交易代码	202010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 3 月 21 日
报告期末基金份额总额	608,388,990.86 份
投资目标	本基金为混合型基金，重点投资于具备持续良好盈利和分红能力、分红政策稳定的上市公司，以及高债息固定收益类投资品种。同时积极把握资本利得机会以拓展收益空间，力争为投资者谋求超越基准的投资回报与长期稳健的资产增值。
投资策略	本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，定期或不定期地进行调整，以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	90%×上证红利指数+10%×上证国债指数
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，高于债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司

基金托管人	中国建设银行股份有限公司
-------	--------------

§ 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（2023 年 4 月 1 日—2023 年 6 月 30 日）
1.本期已实现收益	5,012,801.41
2.本期利润	-12,852,723.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0210
4.期末基金资产净值	673,705,073.42
5.期末基金份额净值	1.107

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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；

2、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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

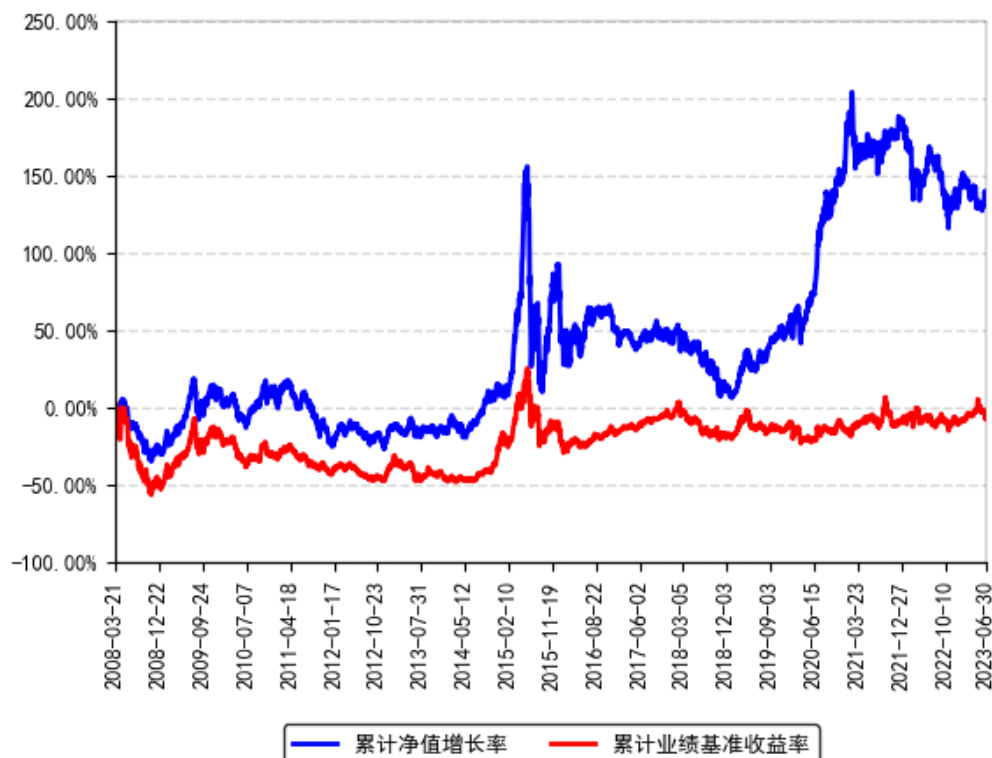
3.2 基金净值表现

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.86%	0.73%	-1.00%	0.85%	-0.86%	-0.12%
过去六个月	1.71%	0.75%	4.78%	0.72%	-3.07%	0.03%
过去一年	-11.72%	0.91%	-0.05%	0.87%	-11.67%	0.04%
过去三年	27.58%	1.12%	19.47%	1.03%	8.11%	0.09%
过去五年	79.59%	1.20%	10.33%	1.04%	69.26%	0.16%
自基金合同生效起至今	136.95%	1.55%	-6.01%	1.42%	142.96%	0.13%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

南方盛元红利混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴冉劫	本基金基金经理	2022年7月8日	-	10年	厦门大学财务学专业硕士，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。曾就职于国泰君安证券股份有限公司，任高级分析师。2015年7月加入南方基金，任权益研究部高级研究员；2016年3月18日至2017年6月19日，任投资经理助理；2017年6月19日至2021年1月22日，任投资经理；2021年1月22日至今，任南方安睿混合基金经理；2022年5月23日至今，任南方誉恒一年持有混合基金经理；2022年7月8日至今，任南方盛元基金经理；2022年8月8日至今，兼任投资经理；2022年10月21日至今，任南方宝升混合基金经理；2023

					年 6 月 20 日至今，任南方津享稳健添利债券基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------------

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
吴冉劫	公募基金	5	4,010,746,243.73	2021 年 01 月 22 日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	61	71,716,642,932.37	2017 年 06 月 22 日
	合计	66	75,727,389,176.10	-

注 报告期内，基金经理（吴冉劫）不再担任 1 个其他组合的投资经理职务，离任日期为 2023 年 04 月 17 日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、中国证监会和本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利益。本报告期内，本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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本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 10 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年二季度 A 股市场呈现先扬后抑的震荡格局，相较一季度波动加大，板块间走势分化仍然明显。投资者对于经济预期的分歧逐渐加大，是影响二季度市场走势的重要因素。一季度国内经济复苏趋势良好，但二季度起，经济数据转弱，如官方制造业 PMI，4-6 月分别为 49.2、48.8 和 49，较 1 季度大幅回落，持续处于收缩区间。国内经济数据旺季不旺、趋势走弱，受此影响，市场分歧加大，缺少增量资金，顺周期行业走势较弱。二季度沪深 300 指数下跌 5.15%、创业板指下跌 7.69%，其中通信、传媒、家用电器涨幅居前，商贸零售、建筑材料、食品饮料等行业跌幅居前。本基金二季度仍然维持高仓位运作，坚持以“好公司、好价格”的投资理念进行选股和投资。市场分歧加大的时期，往往也会产生错误定价，给我们提供更好的投资标的和投资机会。二季度我们增加了消费行业的持仓，同时逆向增加了顺周期资产，整体运作保持稳健。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.107 元，报告期内，份额净值增长率为-1.86%，同期业绩基准增长率为-1.00%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	559,287,487.50	74.70
	其中：股票	559,287,487.50	74.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	38,885,128.58	5.19
	其中：债券	38,885,128.58	5.19
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	73,074,051.29	9.76
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	5,179,305.26	0.69
8	其他资产	72,247,356.68	9.65
9	合计	748,673,329.31	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	412,302,204.59	61.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	710,132.47	0.11
E	建筑业	8,140.64	0.00
F	批发和零售业	22,175,411.72	3.29
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,558,591.45	6.47
J	金融业	31,509,104.00	4.68
K	房地产业	7,935,270.00	1.18
L	租赁和商务服务业	26,780,792.83	3.98
M	科学研究和技术服务业	7,599,305.39	1.13
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,700,794.41	0.99
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	559,287,487.50	83.02

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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

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	600519	贵州茅台	26,800	45,318,800.00	6.73
2	300750	宁德时代	114,349	26,161,907.71	3.88
3	600887	伊利股份	807,040	22,855,372.80	3.39

4	600153	建发股份	2,020,200	22,040,382.00	3.27
5	600660	福耀玻璃	593,800	21,287,730.00	3.16
6	002126	银轮股份	1,184,700	20,969,190.00	3.11
7	000001	平安银行	1,540,200	17,296,446.00	2.57
8	002027	分众传媒	2,453,563	16,708,764.03	2.48
9	000333	美的集团	283,513	16,704,585.96	2.48
10	002459	晶澳科技	398,688	16,625,289.60	2.47

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	25,379,549.56	3.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,927,204.00	1.47
	其中：政策性金融债	9,927,204.00	1.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,578,375.02	0.53
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	38,885,128.58	5.77

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019694	23 国债 01	144,000	14,559,788.71	2.16
2	019688	22 国债 23	107,000	10,819,760.85	1.61
3	018021	国开 2303	98,000	9,927,204.00	1.47
4	110059	浦发转债	23,670	2,558,544.12	0.38
5	113052	兴业转债	10,000	1,017,130.68	0.15

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

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**

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注**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，还应对相关证券的投资决策程序做出说明**

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	153,375.89
2	应收证券清算款	72,034,374.63

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	59,606.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	72,247,356.68

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	2,558,544.12	0.38
2	113052	兴业转债	1,017,130.68	0.15

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	613,031,210.86
报告期期间基金总申购份额	8,673,136.83
减：报告期期间基金总赎回份额	13,315,356.83
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	608,388,990.86

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《南方盛元红利混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方盛元红利混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、南方盛元红利混合型证券投资基金 2023 年 2 季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

9.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>