

南方信息创新混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 1 月 22 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 2024 年 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 南方信息创新混合 |
| 基金主代码 | 007490 |
| 交易代码 | 007490 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 6 月 19 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,469,858,641.62 份 |
| 投资目标 | 本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化行业深度研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，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，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。 |
| 业绩比较基准 | 中证信息技术指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*10%+上证国债指数收益率*30% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金 |

| | | |
|-----------------|--|------------------|
| | 类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 南方信息创新混合 A | 南方信息创新混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 007490 | 007491 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,692,552,803.88 份 | 777,305,837.74 份 |

§ 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 10 月 1 日—2023 年 12 月 31 日） | |
|----------------|---------------------------------------|------------------|
| | 南方信息创新混合 A | 南方信息创新混合 C |
| 1.本期已实现收益 | -75,375,606.91 | -39,945,848.38 |
| 2.本期利润 | 11,431,294.91 | 5,737,934.04 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0074 | 0.0073 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,666,909,127.36 | 1,181,386,102.73 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.5757 | 1.5198 |

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

南方信息创新混合 A

| 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 | 0.65% | 1.73% | -1.14% | 0.80% | 1.79% | 0.93% |
| 过去六个月 | -11.94% | 1.85% | -8.04% | 0.87% | -3.90% | 0.98% |
| 过去一年 | 9.39% | 2.03% | 1.81% | 0.97% | 7.58% | 1.06% |
| 过去三年 | -28.24% | 1.89% | -19.84% | 1.01% | -8.40% | 0.88% |
| 自基金合同 | 57.57% | 1.93% | 14.28% | 1.11% | 43.29% | 0.82% |

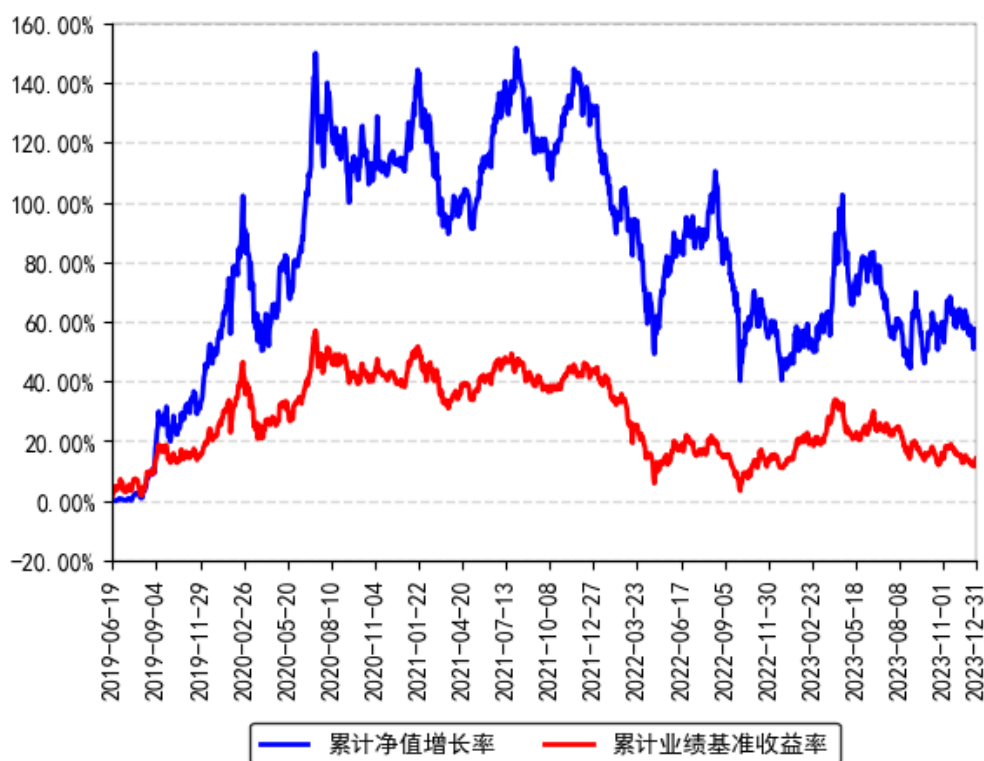
| | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|

南方信息创新混合 C

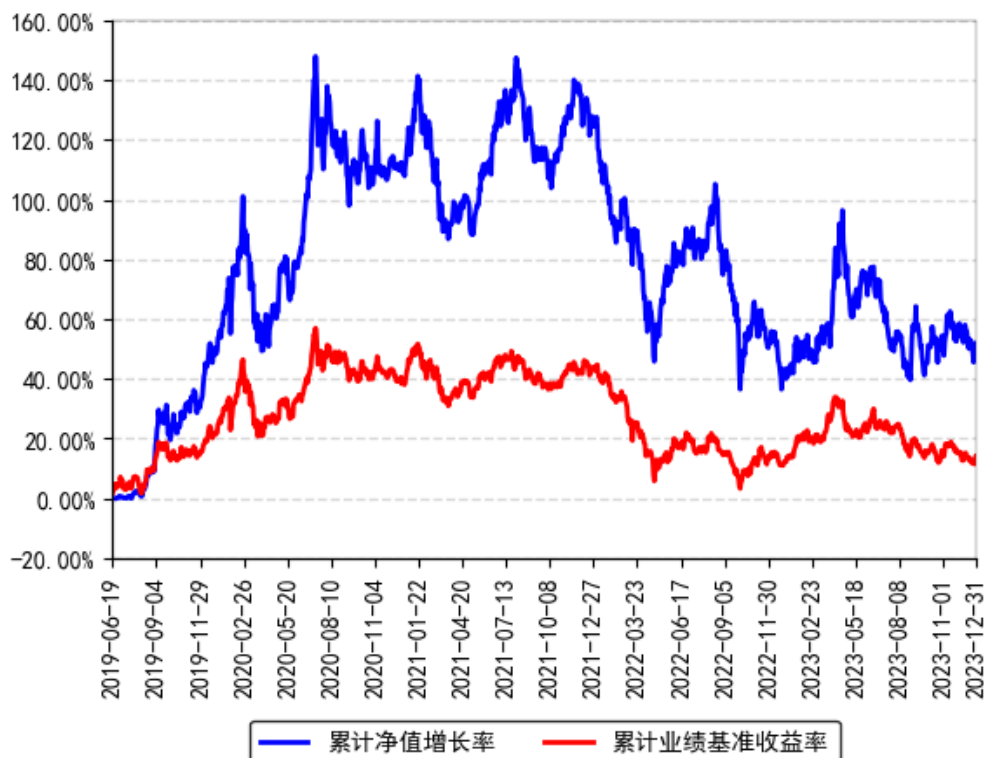
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 0.44% | 1.73% | -1.14% | 0.80% | 1.58% | 0.93% |
| 过去六个月 | -12.30% | 1.85% | -8.04% | 0.87% | -4.26% | 0.98% |
| 过去一年 | 8.51% | 2.03% | 1.81% | 0.97% | 6.70% | 1.06% |
| 过去三年 | -29.94% | 1.89% | -19.84% | 1.01% | -10.10% | 0.88% |
| 自基金合同生效起至今 | 51.98% | 1.93% | 14.28% | 1.11% | 37.70% | 0.82% |

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

南方信息创新混合A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



南方信息创新混合C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 | | |
| 茅炜 | 本基金基金经理 | 2019年6月19日 | - | 15年 | 上海财经大学保险学学士，具有基金从业资格。曾任职于东方人寿保险公司及生命人寿保险公司，担任保险精算员，在国金证券研究所任职期间，担任保险及金融行业研究员。2009年加入南方基金，历任研究部保险及金融行业研究员、研究部总监助理、副总监、执行总监、总监、权益研究部总经理、权益投资部总经理，现任首席投资官（权益）、董事总经理、资产配置委员会主席、境内权益投资决策委员会主席；2012年10月12日至2016年1月26日，兼任专户投资管理部投资经理；2018年2月2日至2020年2月7日，任南方教育股票基金经理； |

| | | | | | |
|-----|---------|-----------------|---|---|---|
| | | | | 2018 年 6 月 8 日至 2020 年 4 月 10 日，任南方医保基金经理；2016 年 2 月 3 日至 2020 年 5 月 15 日，任南方君选基金经理；2019 年 12 月 6 日至 2020 年 11 月 17 日，任南方消费基金经理；2019 年 3 月 29 日至 2020 年 11 月 20 日，任南方军工混合基金经理；2020 年 2 月 7 日至 2021 年 6 月 18 日，任南方高端装备基金经理；2020 年 11 月 17 日至 2021 年 6 月 18 日，任南方消费基金经理；2019 年 12 月 20 日至 2021 年 8 月 3 日，任南方配售基金经理；2020 年 7 月 28 日至 2021 年 10 月 15 日，任科创板基金基金经理；2019 年 5 月 6 日至 2022 年 1 月 27 日，任南方科技创新混合基金经理；2021 年 8 月 3 日至 2022 年 11 月 11 日，任南方优势产业混合基金经理；2021 年 9 月 7 日至 2022 年 11 月 11 日，任南方均衡优选一年持有期混合基金经理；2018 年 5 月 30 日至今，任南方君信混合基金经理；2019 年 6 月 19 日至今，任南方信息创新混合基金经理；2020 年 6 月 12 日至今，任南方成长先锋混合基金经理；2020 年 8 月 4 日至今，任南方景气驱动混合基金经理；2022 年 8 月 23 日至今，任南方高质量优选混合基金经理。 | |
| 郑晓曦 | 本基金基金经理 | 2019 年 6 月 19 日 | - | 15 年 | 女，中国人民大学金融学硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金，历任助理研究员、研究员、高级研究员，负责建材和通信行业研究。2016 年 5 月 10 日至 2019 年 6 月 21 日，任南方积配、南方中国梦的基金经理助理。2019 年 6 月 19 日至今，任南方信息创新混合基金经理；2020 年 11 月 20 日至今，任南方军工混合基金经理。 |

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。

4.2 管理人对报告期内本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 7 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

经历了 10 月的回调之后，11 月以来市场预期资金宽松，美国主要指数持续反弹，整体四季度海外市场普遍上涨。国内 AH 指数小幅下跌，情绪处于低迷状态。风格来看，小盘跑赢大盘，价值跑赢成长，煤炭和公用事业等高股息行业以及科技中的电子行业表现较好，房地产、大消费、新能源等表现不佳。四季度北向资金延续流出，其中交易型资金流出为主。估值来看，目前 A 股整体估值处于历史底部区域，几乎所有行业的估值落在中低位置区间。

四季度国内经济基本面平稳，工业、投资与消费小幅弱于季节性，出口有一定压力，基建和制造业保持强劲。10 月国内政策持续积极出台，全国人大常委会批准新增 1 万亿元国债额度，并将年度预算赤字目标从占 GDP 的 3.0% 上调至 3.8%。10 月以来科技领域热点不断，华为新品集中上市带动电子、汽车行业逆势上涨。

中央经济工作会议对 2024 年经济工作部署突出稳增长要求，强调“高质量发展是硬道理”。提出以科技创新推动产业创新，特别是以颠覆性技术和前沿技术催生新产业、新模式、新动能，发展新质生产力。完善新型举国体制，实施制造业重点产业链高质量发展行动，加强质量支撑和标准引领，提升产业链供应链韧性和安全水平。

全球流动性拐点将至，美联储加息进入尾声，支持成长股走强。美国 10 月 CPI 低于市场预期，引起投资者对于未来降息的乐观预期，11 月 FOMC 不加息，发布会结束后 10 年美债利率下行，12 月 FOMC 后，美联储确认加息周期结束，并暗示讨论降息，全球风险偏好明显提振。

中美关系持续升温，近期一系列互访有望推动双方关系回到健康稳定发展轨道。11 月习主席代表团访美期间受到很高的外交礼遇的热情接待。过去半年工作层级的互动密集，为中美元首峰会打下了良好基础，在经济、科技、气候、军事、外交等领域，双方有诸多领域可以合作，并推动后续的进一步沟通。

2022 年三季度至今，本基金增加了半导体板块的配置，2023 年本基金持续集中投资半导体自主可控子行业，聚焦在半导体设备、零部件、材料、EDA 软件等领域。近年来国产化率提升，国内晶圆厂持续扩产，核心设备和零部件陆续突破，龙头公司的在手订单和收入持续超预期，本基金看好自主可控带来的半导体国产替代的大趋势。

展望后市，疫后国内经济进入恢复期，财政政策温和，货币政策宽松，海外美联储加息周期已近尾声，流动性拐点将至，支持全球成长股行情走强。目前国内外宏观经济是对科技成长板块比较友好的，持续看好科技成长的投资机会。

国内十四五规划重点支持科技创新板块，强调创新驱动、自主可控，大幅提升科技实力，实现关键核心技术重大突破，进入创新型国家前列。技术创新突破为我国科技提供赶超机会，是下一轮科技革命中占据有利地位的必要因素。同时，新一轮科技创新周期开启，5G 基站和手机、VR/AR 眼镜、人工智能、云计算、云游戏、在线办公、远程医疗、工业互联网、汽车智能化、车联网、机器人等新需求开始爆发。

我们坚定看好国家产业升级的大方向，半导体是工业发展的基石，以几千亿美金的市场规模支持了几十万亿美金的庞大下游市场。2023-2024 年，我们认为半导体将会迎来自可控和周期拐点向上的共振。

第一，国内成熟制程半导体制造产业链的自主可控将加速，同时保持对先进制程的追赶，在政府和产业界的共同努力下，我们对半导体的自主可控更加乐观，国产化率将持续提升。

第二，景气下行的消费电子半导体领域，价格和库存等指标已经接近周期底部，需求的向上波动会带来供给端补库存，有望迎来景气上行拐点。

第三，高景气高需求的赛道，包括汽车芯片、功率半导体、高端工控芯片、特种装备芯片等领域，有望在竞争格局优化后，重回高增长。

本基金将持续聚焦科技创新和自主可控，在板块震荡中提升持仓集中度，精选绩优科技龙头，持续投向半导体芯片、自主可控等科技创新方向。我们坚信中长期科技创新和自主可控是重要的发展方向，不惧短期市场调整，持续聚焦半导体芯片引领的信息科技创新行业新机遇。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.5757 元，报告期内，份额净值增长率为 0.65%，同期业绩基准增长率为-1.14%；本基金 C 份额净值为 1.5198 元，报告期内，份额净值增长率为 0.44%，同期业绩基准增长率为-1.14%。

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 | 3,614,226,546.50 | 91.86 |
| | 其中：股票 | 3,614,226,546.50 | 91.86 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 178,439,495.02 | 4.54 |
| | 其中：债券 | 178,439,495.02 | 4.54 |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 117,880,862.64 | 3.00 |
| 8 | 其他资产 | 23,832,373.71 | 0.61 |
| 9 | 合计 | 3,934,379,277.87 | 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 | 3,279,428,039.81 | 85.22 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 32,207.85 | 0.00 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 39,389.60 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 13,981.41 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 334,664,303.26 | 8.70 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,058.00 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 26,564.46 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 19,002.11 | 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,614,226,546.50 | 93.92 |

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 | 002371 | 北方华创 | 1,383,156 | 339,855,260.76 | 8.83 |
| 2 | 688072 | 拓荆科技 | 1,417,063 | 327,186,511.90 | 8.50 |
| 3 | 300567 | 精测电子 | 3,696,955 | 323,927,197.10 | 8.42 |
| 4 | 688012 | 中微公司 | 2,087,893 | 320,700,364.80 | 8.33 |
| 5 | 688361 | 中科飞测 | 4,128,991 | 307,320,800.13 | 7.99 |
| 6 | 688037 | 芯源微 | 2,281,397 | 304,817,453.17 | 7.92 |
| 7 | 688120 | 华海清科 | 1,610,481 | 302,287,283.70 | 7.86 |
| 8 | 688279 | 峰昭科技 | 1,587,905 | 200,266,578.60 | 5.20 |
| 9 | 688409 | 富创精密 | 2,487,732 | 194,814,292.92 | 5.06 |
| 10 | 688652 | 京仪装备 | 2,195,961 | 132,303,322.25 | 3.44 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 172,514,075.90 | 4.48 |
| | 其中：政策性金融债 | 172,514,075.90 | 4.48 |
| 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） | 5,925,419.12 | 0.15 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 178,439,495.02 | 4.64 |

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 | 220322 | 22 进出 22 | 1,200,000 | 121,028,295.08 | 3.14 |
| 2 | 190305 | 19 进出 05 | 500,000 | 51,485,780.82 | 1.34 |
| 3 | 123176 | 精测转 2 | 36,803 | 5,925,419.12 | 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

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，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。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，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。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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 | 546,892.31 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 23,285,481.40 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 23,832,373.71 |

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 | 123176 | 精测转 2 | 5,925,419.12 | 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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 688072 | 拓荆科技 | 33,652,240.00 | 0.87 | 大宗交易锁定期 |
| 2 | 688652 | 京仪装备 | 21,736.00 | 0.00 | 新股锁定期 |

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 南方信息创新混合 A | 南方信息创新混合 C |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,507,834,771.37 | 772,270,379.29 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 225,821,494.61 | 92,695,828.02 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 41,103,462.10 | 87,660,369.57 |
| 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 | 1,692,552,803.88 | 777,305,837.74 |

§ 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--|----------------|--------------------------|----------------|------|------|----------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20231001-20231231 | 632,166,046.16 | - | - | 632,166,046.16 | 25.60% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。 | | | | | | | |

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

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、《南方信息创新混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方信息创新混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、南方信息创新混合型证券投资基金 2023 年 4 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>

