

# 南方荣优鑫年享定期开放混合型证券投资 基金 2018 年第 1 季度报告

2018 年 03 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 04 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 4 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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 南方荣优鑫年享定期开放混合   |
| 基金主代码      | 003807  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2017 年 03 月 24 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 740,251,844.65 份  |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。   |
| 投资策略       | <p>1、资产配置策略 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，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、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。</p> <p>2、股票投资策略 本基金依托于基金管理人的投资研究平台，紧密跟踪中国经济结构转型的改革方向，努力探寻在调结构、促改革中具备长期价值增长潜力的上市公司。股票投资采用定量和定性分析相结合的策略。基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性，对组合进行优化，</p> |

在合理风险水平下追求基金收益最大化，同时监控组合中证券的估值水平，在市场价格明显高于其内在合理价值时适时卖出证券。

3、债券投资策略 在选择债券品种时，首先根据宏观经济、资金面动向、发行人情况和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术选择个券，选择被价格低估的债券进行投资。本基金投资于中小企业私募债。由于中小企业私募债券整体流动性相对较差，且整体信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。

4、权证投资策略 本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征，主要考虑运用的策略包括：价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。

5、资产支持证券投资策略 资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

6、开放期投资策略 本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

|                 |   |              |
|-----------------|---|--------------|
| 业绩比较基准          | 沪深 300 指数收益率×15%+中债综合指数收益率×85%                  |              |
| 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、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           | 中国民生银行股份有限公司                                    |              |
| 下属分级基金的基金简称     | 南方荣优 A  | 南方荣优 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 003807  | 003808       |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 740,132,838.80 份                                | 119,005.85 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“南方荣优”。

### § 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(2018年01月01日 - 2018年03月31日) |            |
|-----------------|--------------------------------|------------|
|                 | 南方荣优 A                         | 南方荣优 C     |
| 1. 本期已实现收益      | 13,337,006.73                  | 3,700.51   |
| 2. 本期利润         | 4,681,510.08                   | 907.40     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0063                         | 0.0042     |
| 4. 期末基金资产净值     | 801,761,564.11                 | 128,389.19 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0833                         | 1.0788     |

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

南方荣优 A

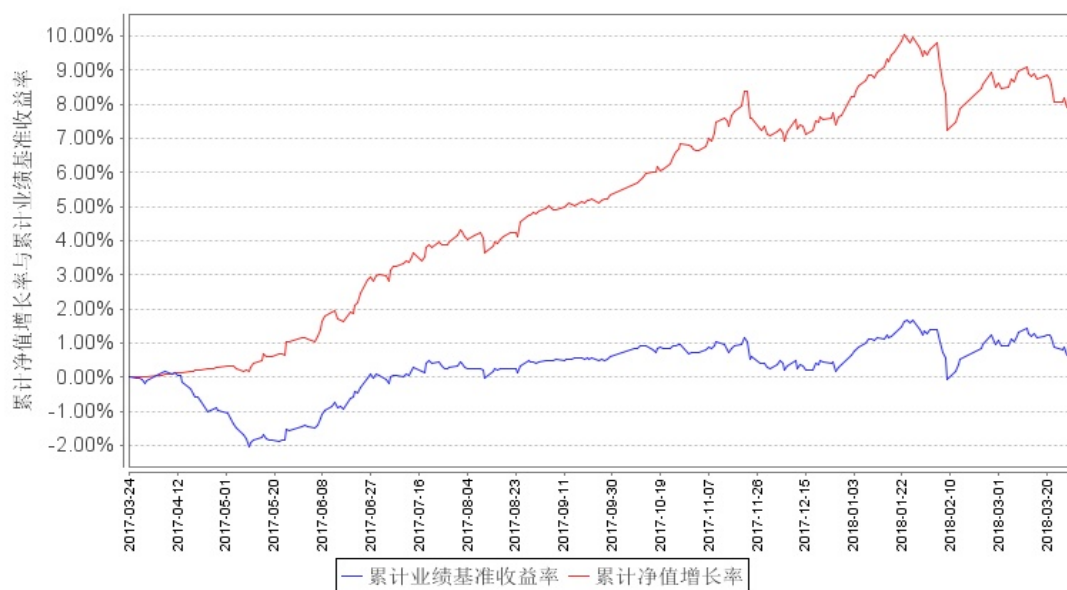
| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 0.59%  | 0.25%     | 0.51%      | 0.17%         | 0.08% | 0.08% |

南方荣优 C

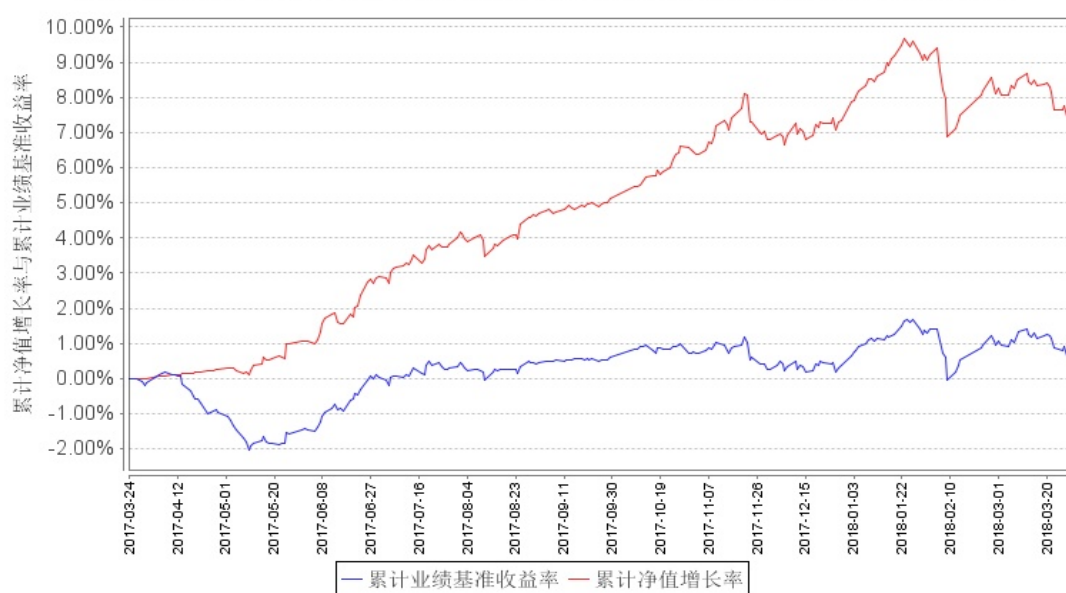
| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.48%  | 0.25%     | 0.51%      | 0.17%         | -0.03% | 0.08% |

#### 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

南方荣优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



南方荣优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



注：本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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 |        |  |
| 李佳亮 | 本基金基金经理 | 2017年4月13日  |      | 5年     | 美国南加州大学金融工程硕士，注册金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2012年8月加入南方基金，任量化投资部研究员；2015年5月至2016年8月，任量化投资经理助理；2016年8月至今，任南方消费基金经理；2016年11月至今，任南方中证500增强基金经理；2016年12月至今，任南方绝对收益基金经理；2017年4月至今，任南方荣优基金经理；2017年11月至今，任大数据100、大数据300、南方量化成长基金经理。                     |
| 李璇  | 本基金基金经理 | 2017年3月24日  |      | 10年    | 女，清华大学金融学学士、硕士，注册金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2007年加入南方基金，担任信用债高级分析师，现任固定收益投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员。2010年9月至2012年6月，任南方宝元基金经理；2012年12月至2014年9月，任南方安心基金经理；2015年12月至2017年2月，任南方润元基金经理；2013年7月至2017年9月，任南方稳利基金经理；2016年8月至2017年12月，任南方通利、南方荣冠基金经理；2016年8月 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 至 2018 年 2 月，任南方丰元基金经理；2016 年 11 月至 2018 年 2 月，任南方荣安基金经理；2010 年 9 月至今，任南方多利基金经理；2012 年 5 月至今，任南方金利基金经理；2016 年 9 月至今，任南方多元基金经理；2016 年 12 月至今，任南方睿见混合基金经理；2017 年 1 月至今，任南方宏元、南方和利基金经理；2017 年 3 月至今，任南方荣优基金经理；2017 年 5 月至今，任南方荣尊基金经理；2017 年 6 月至今，任南方荣知基金经理；2017 年 7 月至今，任南方荣年基金经理；2017 年 9 月至今，任南方兴利基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

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；对此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、中国证监会和《南方荣优鑫年享定期开放混合型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均未超过该证券当日成交量的 5%。

## 4.4 报告期内基金的投资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

一季度经济开局较好，1-2 月主要经济数据超市场预期，工业增加值同比增长 7.2%，固定资产投资同比增长 7.9%，其中房地产投资同比增长 9.9%，基建投资同比增长 16.1%，制造业投资同比增长 4.3%，投资数据较 2017 年抬升明显，地产投资主要受拿地支出滞后效应的影响，而制

制造业和基建投资则相对平稳。受春节错位和气候因素的影响，叠加去年基数较低，2 月 CPI 同比增长 2.9%，PPI 在高基数的影响下持续回落，2 月同比增幅降至 3.7%。年初 M2 增速企稳回升，1 月和 2 月分别为 8.6%和 8.8%，受非标融资收紧的影响，1-2 月表内信贷增长较快，但社融整体弱于去年。美联储 3 月加息 25BP，将联邦基金利率目标调升至 1.50%-1.75%，同时上调了经济增长预期，但对通胀预期依然谨慎。欧央行 3 月维持各项利率不变，对措辞做了微调，删除了有关在经济前景恶化时可能进一步扩大 QE 规模或延长 QE 期限的表述。一季度美元指数先跌后稳，人民币兑美元汇率中间价升值。美联储加息后，央行跟随上调了公开市场操作利率 5BP，7 天逆回购利率上调至 2.55%。央行在春节前分别实行“临时准备金政策”和“定向降准”，维护了市场流动性的合理稳定。债券市场方面，一季度收益率先上后下，最终录得较大幅度的下行。1 年国开、1 年国债收益率分别下行 47BP、67BP。10 年国开、10 年国债收益率分别下行 14BP、18BP，利率曲线陡峭化下移。3 年期信用债整体表现好于同期限国开债，中票表现好于城投，AAA 表现好于 AA。一季度权益市场先涨后跌，上证综指最终下跌 4.18%，结构分化显著，创业板表现大幅超越大盘蓝筹，沪深 300、中小板指和创业板指涨幅分别为-3.28%、-1.47%和 8.43%。转债市场的波动不亚于股指，1 月上证转债指数大幅上涨 7.81%，2、3 月连续下跌，一季度中证转债指数上涨 2.91%。投资运作上，债券部分，由于一季度经济数据表现仍然不弱，因此我们认为债券机会不大，采取了中性久期和中性仓位的策略，整体来看，这一策略一季度表现相对较好，为组合获取了较高的绝对收益。后续我们对市场观点中性，认为短期难有趋势性行情，因此信用债仍将是赚取票息收益，适当通过利率债做一些波段操作来获取超额收益。权益部分，2018 年 1 季度 A 股由于前期涨幅较多，且受到贸易战及海外股市暴跌等诸多因素影响，经历了较大幅度调整，目前正处于震荡阶段。本报告期内权益部分进行了股票换仓，充分借助南方大数据量化平台的研究成果，根据多因子模型，风格模型及风险模型生成投资组合进行股票投资，风格偏好低估值蓝筹。展望 2018 年二季度，经济层面，年初经济数据高增长有部分短期因素的影响，预计后期将有所回落，上半年经济整体平稳。通胀方面，基数从低点回升，预计二季度 CPI 将小幅回落，PPI 则在下行后逐步企稳。全年 CPI 中枢 2.5%左右，难以突破 3.0%，PPI 中枢 3.5%左右，较 2017 年显著下降。政策方面，美联储如期加息，目前市场主流的加息预期仍为 3 次。欧央行维持利率水平不变，整体表态中性。国内方面，央行积极维护银行间流动性的合理稳定，货币政策回归实质中性，严格的监管政策配合中性的货币政策依然是今年的主基调。债市策略方面，利率债前期收益率下行较快，短期内或有一定的震荡盘整，当前信用债收益率依然具有较好的配置价值，但信用利差保护较小，需防范后期配置力量变化和信用风险事件对信用利差造成的冲击。在当前紧信用的背景下，企业融资环境恶化，需严防信用风险，加强对于持仓债



券的跟踪。权益市场方面，当前环境下脱离业绩和估值炒作题材难以持续，价值股和成长股都有机会，自下而上挖掘业绩有望超预期、估值便宜的公司。转债个券数量大幅增加，存在较多的结构性机会值得挖掘。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 级基金净值增长率为 0.59%，同期业绩比较基准增长率为 0.51%；C 级基金净值增长率为 0.48%，同期业绩比较基准增长率为 0.51%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内有连续二十个工作日持有人低于 200 人的情形。

## § 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（人民币元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 143,867,191.63   | 13.08        |
|    | 其中：股票             | 143,867,191.63   | 13.08        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 917,794,364.40   | 83.47        |
|    | 其中：债券             | 917,794,364.40   | 83.47        |
|    | 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      | 27,214,266.26    | 2.48         |
| 8  | 其他资产              | 10,644,199.81    | 0.97         |
| 9  | 合计                | 1,099,520,022.10 | 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              | 4,254,909.00  | 0.53         |
| C  | 制造业              | 48,864,371.37 | 6.09         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,635,514.00 | 1.45         |
| E  | 建筑业              | 6,354,736.00  | 0.79         |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
| F | 批发和零售业          | 26,523.07      | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 7,863,370.12   | 0.98  |
| H | 住宿和餐饮业          | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,381,760.76   | 0.42  |
| J | 金融业             | 45,577,047.03  | 5.68  |
| K | 房地产业            | 4,504,303.28   | 0.56  |
| L | 租赁和商务服务业        | 1,317,504.00   | 0.16  |
| M | 科学研究和技术服务业      | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 1,661,604.00   | 0.21  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -              | -     |
| P | 教育              | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | 3,840,540.00   | 0.48  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 4,585,009.00   | 0.57  |
| S | 综合              | -              | -     |
|   | 合计              | 143,867,191.63 | 17.94 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 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  | 601318 | 中国平安 | 206,300   | 13,473,453.00 | 1.68         |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 217,000   | 6,312,530.00  | 0.79         |
| 3  | 300122 | 智飞生物 | 146,690   | 4,984,526.20  | 0.62         |
| 4  | 601288 | 农业银行 | 1,213,100 | 4,743,221.00  | 0.59         |
| 5  | 601328 | 交通银行 | 727,500   | 4,495,950.00  | 0.56         |
| 6  | 601398 | 工商银行 | 721,012   | 4,390,963.08  | 0.55         |
| 7  | 600519 | 贵州茅台 | 4,900     | 3,349,738.00  | 0.42         |
| 8  | 601006 | 大秦铁路 | 403,500   | 3,340,980.00  | 0.42         |
| 9  | 601997 | 贵阳银行 | 226,000   | 3,247,620.00  | 0.40         |
| 10 | 600170 | 上海建工 | 830,300   | 3,105,322.00  | 0.39         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 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      | 60,054,000.00  | 7.49         |
|    | 其中：政策性金融债 | 50,055,000.00  | 6.24         |
| 4  | 企业债券      | 30,154,000.00  | 3.76         |
| 5  | 企业短期融资券   | 641,290,040.00 | 79.97        |
| 6  | 中期票据      | 99,889,000.00  | 12.46        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 4,324.40       | -            |

|    |      |                |        |
|----|------|----------------|--------|
| 8  | 同业存单 | 86,403,000.00  | 10.77  |
| 9  | 其他   | -              | -      |
| 10 | 合计   | 917,794,364.40 | 114.45 |

### 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五名债券投资明细

| 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  | 041753042 | 17 陕煤化 CP003  | 500,000 | 50,185,000.00 | 6.26         |
| 2  | 101756038 | 17 河钢集 MTN015 | 500,000 | 50,125,000.00 | 6.25         |
| 3  | 180404    | 18 农发 04      | 500,000 | 50,055,000.00 | 6.24         |
| 4  | 011800192 | 18 镇城投 SCP002 | 400,000 | 40,164,000.00 | 5.01         |
| 5  | 101555026 | 15 金川 MTN003  | 400,000 | 39,944,000.00 | 4.98         |

### 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

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

#### 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(人民币元)      |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 32,941.30     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 10,611,258.51 |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 5 | 应收申购款 | -             |
| 6 | 其他应收款 | -             |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
| 9 | 合计    | 10,644,199.81 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末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

| 项目                        | 南方荣优 A         | 南方荣优 C     |
|---------------------------|----------------|------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 740,163,795.41 | 220,811.01 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 9.21           | -          |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 30,965.82      | 101,805.16 |
| 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               | 740,132,838.80 | 119,005.85 |

## § 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

注：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

注：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              | 20180101-20180331       | 740,038,055.55 | -    | -    | 740,038,055.55 | 99.97   |
| 个人  | -              | -                       | -              | -    | -    | -              | -       |
| 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。 |                |                         |                |      |      |                |         |

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、《南方荣优鑫年享定期开放混合型证券投资基金基金合同》。
- 2、《南方荣优鑫年享定期开放混合型证券投资基金托管协议》。
- 3、南方荣优鑫年享定期开放混合型证券投资基金 2018 年 1 季度报告原文。

### 9.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层。

### 9.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>