

# 南方沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 09 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 10 月 27 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	南方沪深 300 指数增强
基金主代码	009059
交易代码	009059
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 23 日
报告期末基金份额总额	207,635,307.65 份
投资目标	本基金为增强型股票指数基金，立足价值投资理念深入研究筛选，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过主动投资基本面优秀、估值合理的个股的方式实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金通过指数复制和主动选股相结合的策略，追求接近或超过标的指数的业绩表现。本基金为增强型指数基金，股票（含存托凭证）投资比例为基金资产的 90%-95%，其中沪深 300 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 80%。除因分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对固定的股票投资比例。如因特殊情况导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，一般而言，其预期风险收益水平高于

	混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方沪深 300 增强 A	南方沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码	009059	009060
报告期末下属分级基金的份额总额	174,818,822.52 份	32,816,485.13 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“南方沪深 300 增强”。

### § 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（2021 年 7 月 1 日—2021 年 9 月 30 日）	
	南方沪深 300 增强 A	南方沪深 300 增强 C
1. 本期已实现收益	7,887,356.68	1,493,508.45
2. 本期利润	-10,710,809.79	-2,263,786.14
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0618	-0.0654
4. 期末基金资产净值	254,313,041.28	47,464,380.99
5. 期末基金份额净值	1.4547	1.4464

注：1、上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；

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

南方沪深 300 增强 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	-4.53%	1.20%	-6.49%	1.14%	1.96%	0.06%
过去六个月	1.65%	1.06%	-3.38%	1.04%	5.03%	0.02%

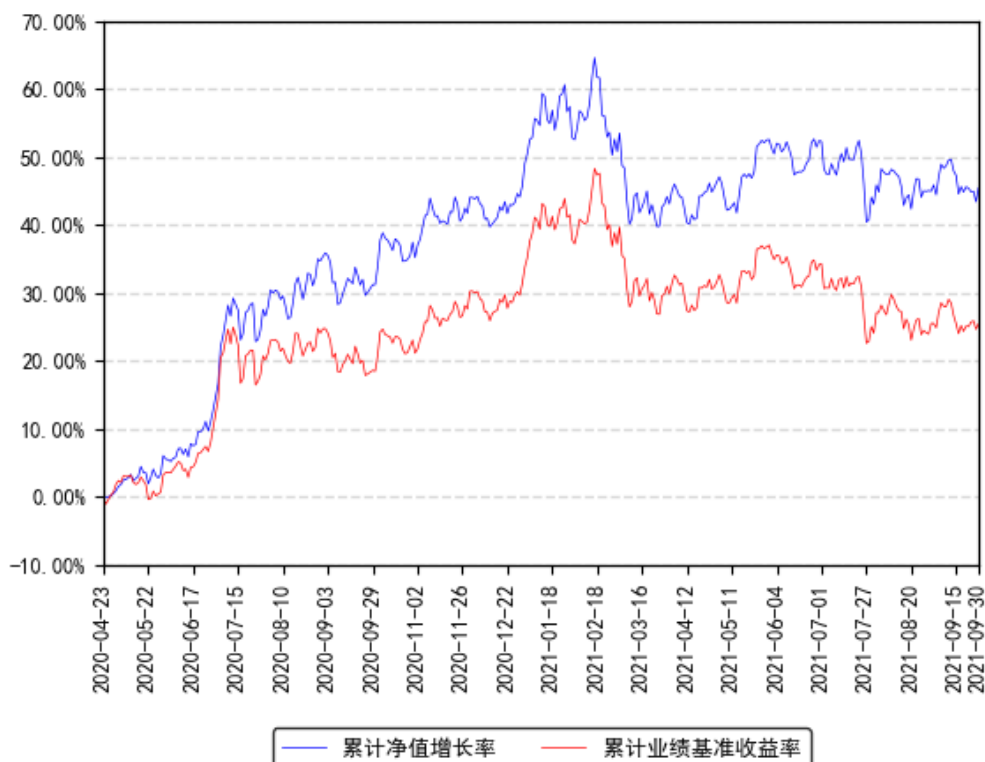
过去一年	10.86%	1.20%	5.88%	1.15%	4.98%	0.05%
自基金合同生效起至今	45.47%	1.22%	25.45%	1.20%	20.02%	0.02%

南方沪深 300 增强 C

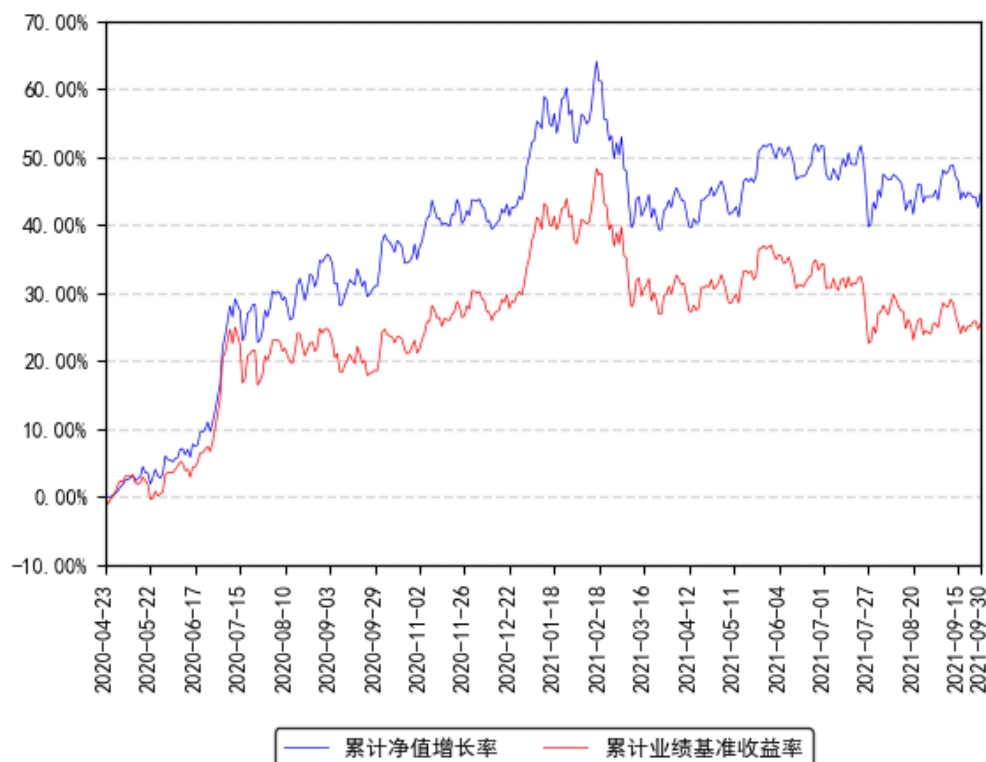
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.63%	1.20%	-6.49%	1.14%	1.86%	0.06%
过去六个月	1.44%	1.06%	-3.38%	1.04%	4.82%	0.02%
过去一年	10.41%	1.20%	5.88%	1.15%	4.53%	0.05%
自基金合同生效起至今	44.64%	1.22%	25.45%	1.20%	19.19%	0.02%

### 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

南方沪深300增强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



南方沪深300增强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：本基金建仓期为 6 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		
李振兴	本基金基金经理	2020年4月23日	-	13年	武汉大学计算机、工商管理双学士，金融学硕士，具有基金从业资格。曾就职于艾默生网络能源有限公司；2008年6月起就职于长城基金管理有限公司，历任行业研究员、研究组组长、基金经理助理；2014年4月18日至2015年10月15日，任长城久利保本、长城保本的基金经理；2014年9月5日至2015年10月15日，任长城久鑫保本的基金经理。2015年10月加入南方基金；2017年6月14日至2019年1月25日，任南方安康混合基金经理；2016年8月1日至今，任南方品质混合基金经理；2017

					年 9 月 13 日至今，任南方兴盛混合基金经理；2017 年 12 月 6 日至今，任南方优享分红混合基金经理；2020 年 4 月 23 日至今，任南方沪深 300 增强基金经理；2021 年 2 月 9 日至今，任南方卓越优选 3 个月持有混合基金经理。
--	--	--	--	--	--

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券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，未出现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% 的情况。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度 A 股整体下跌，沪深 300 下跌 6.85%，深证成指下跌 5.62%，创业板指下跌 6.69%。与指数相比，今年不同板块表现差异度明显拉大且多次出现轮动，年初的食品饮料、二季度的新能源相关及三季度煤炭、有色和化工为代表的周期板块，交替经历快速上涨和回落。在此期间，疫情的反复扰动、新能源相关数据超预期，大宗商品价格快速上行以及前期积累的高估值调整等变化，共同造成了今年市场表现的特殊性。

从全球范围的角度，需求端国内、海外同时扩张；供给端海外受限国内制造业加大输出，形成共振造成了商品供不应求。往后看，欧美消费者耐用消费品的采购热潮褪去，当地消费补贴逐渐取消，出口需求应逐步减弱，而国内供给也在有序恢复。我们认为除个别被强成长行业拉动的大宗品外，商品牛市大体上已处于末期，后续中游企业利润将得到修复。

在投资方向上，我们看好碳中和相关的成长股投资机会——全球变暖让减碳的必要性提升到较高位置，该产业的高景气度和政策支持力度或持续较长时间。除此之外，在经历短期景气下行和估值回落后，我们将增加对医药、消费升级、互联网及其他新兴成长行业的关注度，这些领域的优质公司在国家崛起的大背景下拥有良好的发展前景。我们相信市场最终反应的是每家公司的长期质量，后续具体运作上将继续以长期研究结论为主导，力争寻求良好的投资机会，为持有人创造长期稳健的回报。

#### 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 1.4547 元，报告期内，份额净值增长率为-4.53%，同期业绩基准增长率为-6.49%；本基金 C 份额净值为 1.4464 元，报告期内，份额净值增长率为-4.63%，同期业绩基准增长率为-6.49%。

#### 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	277,647,226.62	91.63
	其中：股票	277,647,226.62	91.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	236,647.60	0.08
	其中：债券	236,647.60	0.08
	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	24,473,554.59	8.08
8	其他资产	642,911.33	0.21
9	合计	303,000,340.14	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资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	1,969,340.20	0.65
B	采矿业	14,611,353.46	4.84
C	制造业	118,899,017.52	39.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,000,346.00	1.66
E	建筑业	3,082,950.00	1.02
F	批发和零售业	981,330.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	5,359,765.90	1.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,582,684.52	2.51
J	金融业	49,953,561.00	16.55
K	房地产业	4,319,481.57	1.43
L	租赁和商务服务业	4,904,868.00	1.63
M	科学研究和技术服务业	4,059,534.00	1.35
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	91,056.00	0.03
Q	卫生和社会工作	2,690,001.20	0.89
R	文化、体育和娱乐业	7,733,381.67	2.56
S	综合	-	-
	合计	231,238,671.04	76.63

### 5.2.2 报告期末积极投资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	-	-
C	制造业	39,963,830.99	13.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,040.50	0.00
E	建筑业	4,733,630.72	1.57
F	批发和零售业	71,169.18	0.02



G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	5,865.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,127,276.11	0.37
J	金融业	401,609.00	0.13
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	57,686.58	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	25,239.04	0.01
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	11,208.02	0.00
S	综合	-	-
	合计	46,408,555.58	15.38

### 5.2.3 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 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

### 5.3.1 报告期末指数投资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	5,600	10,248,000.00	3.40
2	000333	美的集团	145,654	10,137,518.40	3.36
3	601088	中国神华	397,121	8,998,761.86	2.98
4	002142	宁波银行	243,192	8,548,198.80	2.83
5	300413	芒果超媒	168,133	7,328,917.47	2.43
6	300059	东方财富	186,220	6,400,381.40	2.12
7	601012	隆基股份	64,700	5,336,456.00	1.77
8	002415	海康威视	82,200	4,521,000.00	1.50
9	600031	三一重工	156,000	3,968,640.00	1.32
10	002594	比亚迪	15,900	3,967,209.00	1.31

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

### 5.3.2 报告期末积极投资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

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	300750	宁德时代	15,100	7,938,523.00	2.63
2	002709	天赐材料	47,700	7,256,124.00	2.40
3	600875	东方电气	310,100	5,674,830.00	1.88
4	002466	天齐锂业	54,400	5,525,952.00	1.83
5	603906	龙蟠科技	100,080	5,031,021.60	1.67

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

#### 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	236,647.60	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	236,647.60	0.08

#### 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	113050	南银转债	1,700	196,112.00	0.06
2	110081	闻泰转债	310	40,535.60	0.01

#### 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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除宁波银行（证券代码 002142）外其他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。

宁波银行 2020 年 10 月 27 日公告称，因授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对其处以罚款人民币 30 万元，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分。

宁波银行 2021 年 6 月 11 日公告称，因代理销售保险不规范，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对公司罚款人民币 25 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

宁波银行 2021 年 7 月 21 日公告称，因违规为存款人多头开立银行结算账户等原因，中国人民银行宁波市中心支行对公司给予警告，并处罚款 286.2 万元。

宁波银行 2021 年 8 月 6 日公告称，因贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储等原因，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对公司罚款人民币 275 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 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	62,291.62
2	应收证券清算款	35,982.68
3	应收股利	-
4	应收利息	2,638.73
5	应收申购款	541,998.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	642,911.33

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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	南方沪深 300 增强 A	南方沪深 300 增强 C
报告期期初基金份额总额	167,110,186.56	37,334,208.01
报告期期间基金总申购份额	41,361,638.71	9,936,386.61
减：报告期期间基金总赎回份额	33,653,002.75	14,454,109.49
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	174,818,822.52	32,816,485.13

## § 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、《南方沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 3、南方沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年 3 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>