

南方盛元红利混合型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	566,665,296.45 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
-------	--------------

注：1、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“南方盛元”；

2、本基金合同生效后一年内为封闭式，基金合同生效满一年后转为开放式，本基金已于 2009 年 3 月 23 日转为开放式。

§ 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）
1.本期已实现收益	37,379,198.68
2.本期利润	-2,881,005.86
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0049
4.期末基金资产净值	831,248,602.87
5.期末基金份额净值	1.467

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。

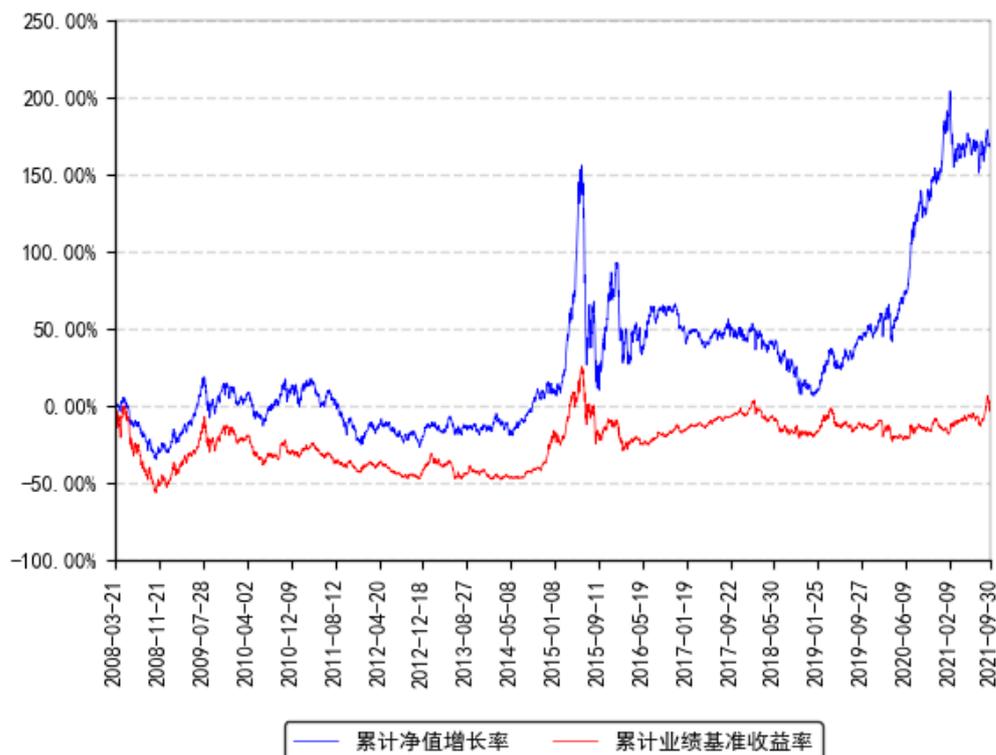
3.2 基金净值表现

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

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	-0.26%	1.17%	3.58%	1.31%	-3.84%	-0.14%
过去六个月	1.12%	1.02%	8.10%	1.08%	-6.98%	-0.06%
过去一年	18.64%	1.19%	16.21%	0.99%	2.43%	0.20%
过去三年	116.78%	1.27%	11.26%	1.06%	105.52%	0.21%
过去五年	69.14%	1.21%	20.93%	0.94%	48.21%	0.27%
自基金合同生效起至今	169.51%	1.61%	-3.36%	1.46%	172.87%	0.15%

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		
林乐峰	本基金基金经理	2019年3月15日	-	13年	北京大学理学硕士，具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金研究部，历任研究员、高级研究员，负责钢铁、机械制造、中小市值的行业研究。2015年2月26日至2016年3月30日，任南方高增长基金经理助理；2017年12月15日至2019年7月5日，任南方甄智混合基金经理；2019年7月5日至2020年12月11日，任南方甄智混合基金经理；2019年1月25日至2021年1月22日，任南方安睿混合基金经理；2016年3月30日至今，任南方宝元基金经理；2017年8月18日至今，任南方安康混合基金经理；2017年12月15日至今，任南方转

					型混合基金经理;2019年1月25日至今,任南方安裕混合基金经理;2019年3月15日至今,任南方盛元基金经理;2019年12月27日至今,任南方宝泰一年混合基金经理;2020年3月5日至今,任南方宝丰混合基金经理;2021年4月27日至今,任南方均衡回报混合基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2021 年第三季度, 国内各项经济数据逐渐转弱, PMI 也跌落荣枯线以下, 这其中既有基数的原因, 也有制造业库存周期进入后期、房地产周期下行等因素的影响。社会融资规模增速也继续回落, 经济各分项中出口继续维持强势, 消费底部盘整, 其他分项趋势较弱。外部方面, 随着疫苗接种率的提升, 海外疫情有望得到控制, 海外处于复苏通道, 但国际能源价格上涨, 美国通胀高企, 美联储的动向值得关注。综合各种因素影响, 三季度国内

A 股市场普遍回调，上证指数下跌 0.64%，沪深 300 指数下跌 6.85%，创业板指下跌 6.69%。所有 27 个行业指数中有 9 个实现上涨，其中采掘、公用事业、有色金属涨幅居前，分别上涨 36.60%、25.20%、23.11%。

我们在配置方面继续坚定持有了具备或潜在具备持续良好盈利和分红能力的公司，重点选择拥有长期竞争力，具备可持续增长和分红能力的个股。除了传统的高股息品种，还包括稳定增长的优质消费品、具备长期成长性的先进制造领域龙头等。对于当前全球通胀上行的局面，金融、公用事业等一些低估值且具备一定抗通胀属性的价值股可能具备较好的配置价值。消费类板块处于左侧位置，以持有一年以上为目标的话可以逐步建仓。此外，基于对出口的持续看好，相应的出口相关制造业产业链也值得配置。成长板块未来会有分化，我们也会在调整到合理位置时进行自下而上的选择性布局。

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 1.467 元，报告期内，份额净值增长率为-0.26%，同期业绩基准增长率为 3.58%。

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	778,766,744.23	92.07
	其中：股票	778,766,744.23	92.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	46,697,731.68	5.52
	其中：债券	46,697,731.68	5.52
	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	2,000,000.00	0.24
	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	5,311,881.47	0.63
8	其他资产	13,093,268.65	1.55

9	合计	845,869,626.03	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	19,287,000.00	2.32
B	采矿业	-	-
C	制造业	473,830,993.24	57.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,350,338.40	5.58
E	建筑业	17,300,183.39	2.08
F	批发和零售业	20,410,222.78	2.46
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,930,429.91	0.95
J	金融业	135,171,476.92	16.26
K	房地产业	20,184,000.00	2.43
L	租赁和商务服务业	23,040,384.00	2.77
M	科学研究和技术服务业	15,225,224.88	1.83
N	水利、环境和公共设施管理业	28,875.97	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	4,269.62	0.00
S	综合	-	-
	合计	778,766,744.23	93.69

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	30,000	54,900,000.00	6.60
2	000001	平安银行	2,500,024	44,825,430.32	5.39
3	601166	兴业银行	2,250,000	41,175,000.00	4.95
4	600887	伊利股份	950,140	35,820,278.00	4.31
5	600690	海尔智家	1,100,018	28,765,470.70	3.46
6	601877	正泰电器	500,000	28,300,000.00	3.40

7	600886	国投电力	2,300,000	27,738,000.00	3.34
8	002597	金禾实业	700,000	27,559,000.00	3.32
9	600741	华域汽车	1,200,000	27,384,000.00	3.29
10	300124	汇川技术	380,006	23,940,378.00	2.88

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	4,989,000.00	0.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,348,000.00	4.85
	其中：政策性金融债	40,348,000.00	4.85
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）	1,360,731.68	0.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	46,697,731.68	5.62

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	120213	12 国开 13	200,000	20,172,000.00	2.43
2	170412	17 农发 12	100,000	10,159,000.00	1.22
3	180412	18 农发 12	100,000	10,017,000.00	1.21
4	019658	21 国债 10	50,000	4,989,000.00	0.60
5	128141	旺能转债	9,968	1,360,731.68	0.16

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除平安银行（证券代码 000001）、兴业银行（证券代码 601166）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。

1、平安银行（证券代码 000001）

平安银行 2020 年 10 月 16 日公告称，因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对公司合计罚款人民币 100 万元

平安银行 2021 年 6 月 8 日公告称，因利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险；固定资产授信严重不审慎，贷款用途审查监控不到位等原因，中国银行保险监督管理委员会云南监管局对公司罚款人民币 210 万元。

2、兴业银行（证券代码 601166）

兴业银行 2021 年 8 月 20 日公告称，因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，中国人民银行对公司罚款 5 万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资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	79,272.34
2	应收证券清算款	11,841,531.57
3	应收股利	-
4	应收利息	790,031.42
5	应收申购款	382,433.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,093,268.65

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	128141	旺能转债	1,360,731.68	0.16

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	607,371,736.88
报告期期间基金总申购份额	17,258,420.44
减：报告期期间基金总赎回份额	57,964,860.87
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	566,665,296.45

§ 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 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>