

# 南方荣尊混合型证券投资基金 2022 年 第 1 季度报告

2022 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 4 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 4 月 20 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 2022 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|             |  |        |
|-------------|--|--------|
| 基金简称        | 南方荣尊混合   |        |
| 基金主代码       | 003938   |        |
| 交易代码        | 003938   |        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式   |        |
| 基金合同生效日     | 2017 年 5 月 22 日  |        |
| 报告期末基金份额总额  | 131,985,524.85 份   |        |
| 投资目标        | 在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析及投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。  |        |
| 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，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。 |        |
| 业绩比较基准      | 沪深 300 指数收益率×15%+中债综合指数（全价）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       | 中国工商银行股份有限公司   |        |
| 下属分级基金的基金简称 | 南方荣尊 A   | 南方荣尊 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003938   | 003939 |

|                     |                  |                |
|---------------------|------------------|----------------|
| 报告期末下属分级基金的份<br>额总额 | 125,144,134.06 份 | 6,841,390.79 份 |
|---------------------|------------------|----------------|

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“南方荣尊”。

2、本基金于 2020 年 6 月 19 日进行了转型变更，将本基金的运作方式由一年定期开放调整为普通开放式，基金名称相应变更为“南方荣尊混合型证券投资基金”。

### § 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（2022 年 1 月 1 日—2022 年 3 月 31 日） |              |
|--------------------|-------------------------------------|--------------|
|                    | 南方荣尊 A                              | 南方荣尊 C       |
| 1.本期已实现收益          | -6,149,907.21                       | -526,752.67  |
| 2.本期利润             | -6,527,597.09                       | -672,361.56  |
| 3.加权平均基金份额本期利<br>润 | -0.0418                             | -0.0440      |
| 4.期末基金资产净值         | 156,555,149.05                      | 8,323,043.94 |
| 5.期末基金份额净值         | 1.2510                              | 1.2166       |

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

南方荣尊 A

| 阶段             | 份额净值增<br>长率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -2.69%       | 0.37%               | -2.17%         | 0.23%                 | -0.52% | 0.14% |
| 过去六个月          | 0.47%        | 0.33%               | -1.43%         | 0.18%                 | 1.90%  | 0.15% |
| 过去一年           | 3.59%        | 0.31%               | -0.80%         | 0.18%                 | 4.39%  | 0.13% |
| 过去三年           | 23.52%       | 0.26%               | 4.68%          | 0.19%                 | 18.84% | 0.07% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 31.25%       | 0.21%               | 11.66%         | 0.18%                 | 19.59% | 0.03% |

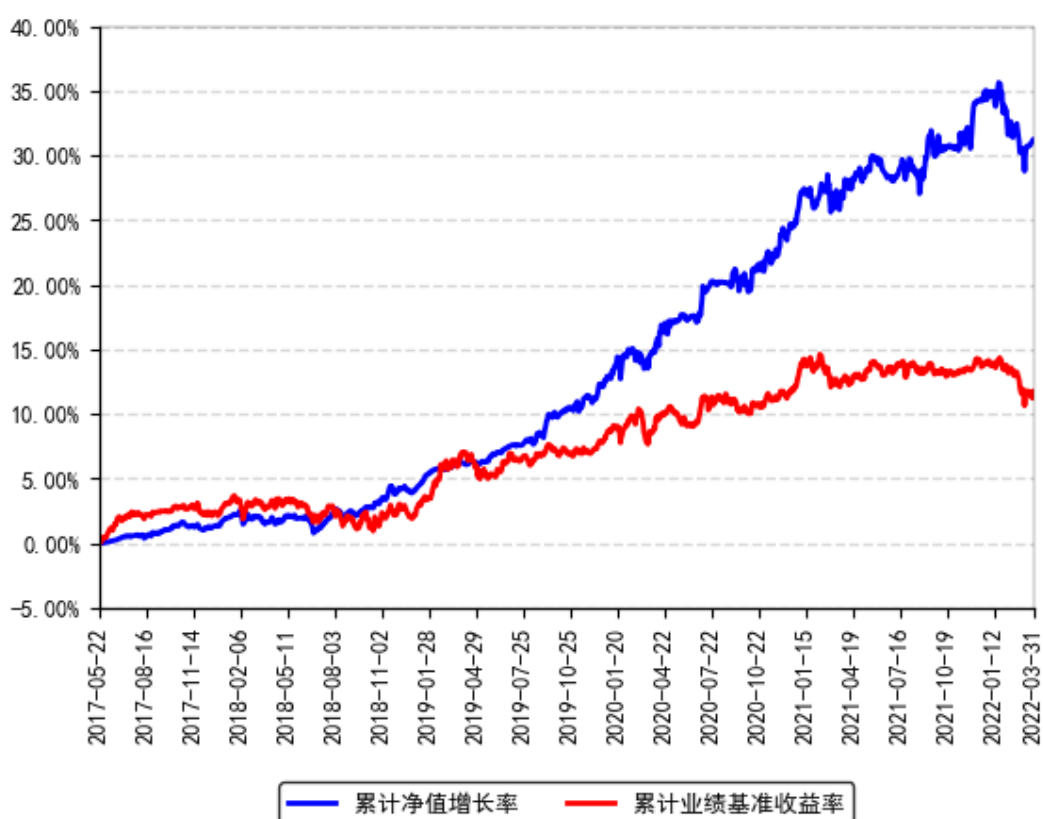
南方荣尊 C

| 阶段 | 份额净值增 | 份额净值增 | 业绩比较基 | 业绩比较基 | ①-③ | ②-④ |
|----|-------|-------|-------|-------|-----|-----|
|----|-------|-------|-------|-------|-----|-----|

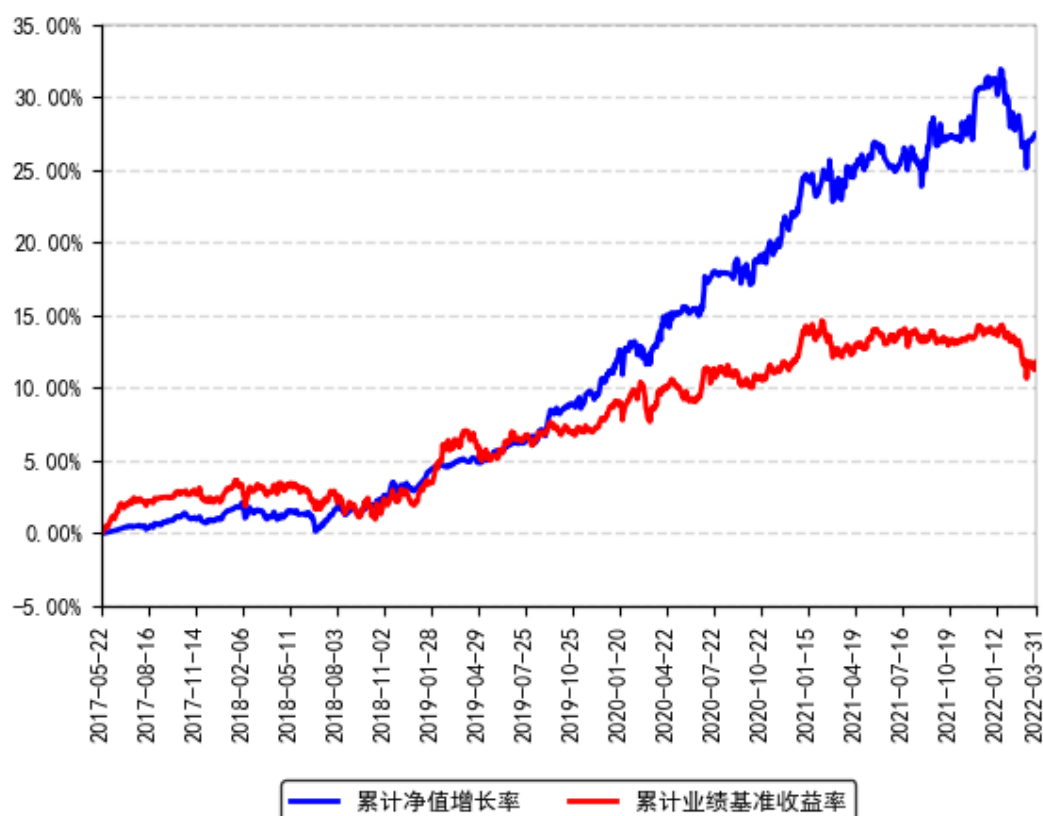
|            | 长率①    | 长率标准差② | 准收益率③  | 准收益率标准差④ |        |       |
|------------|--------|--------|--------|----------|--------|-------|
| 过去三个月      | -2.83% | 0.37%  | -2.17% | 0.23%    | -0.66% | 0.14% |
| 过去六个月      | 0.17%  | 0.33%  | -1.43% | 0.18%    | 1.60%  | 0.15% |
| 过去一年       | 2.98%  | 0.31%  | -0.80% | 0.18%    | 3.78%  | 0.13% |
| 过去三年       | 21.33% | 0.26%  | 4.68%  | 0.19%    | 16.65% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 27.50% | 0.21%  | 11.66% | 0.18%    | 15.84% | 0.03% |

### 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

南方荣尊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



南方荣尊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 |        |  |
| 何康 | 本基金基金经理 | 2020年6月19日  | -    | 17年    | 西南财经大学金融学硕士，具有基金从业资格。曾先后就职于国海证券固定收益部、大成基金固定收益部、南方基金固定收益部、国海证券金融市场部，历任研究员、投资经理、基金经理、副总经理；2013年11月12日至2016年8月5日，任南方丰元基金经理；2013年11月28日至2016年8月5日，任南方聚利基金经理；2014年4月25日至2016年8月5日，任南方通利基金经理；2015年2月10日至2016年8月5日，任南方双元基金经理。2017年6月加入南方基金；2017年8月10日至2019年2月 |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | 26 日，任南方聚利基金经理；2017 年 8 月 10 日至 2020 年 4 月 29 日，任南方双元基金经理；2019 年 3 月 25 日至 2020 年 4 月 29 日，任南方鑫利基金经理；2018 年 5 月 17 日至 2020 年 6 月 19 日，任南方荣尊基金经理；2018 年 9 月 17 日至 2021 年 2 月 26 日，任南方赢元基金经理；2017 年 9 月 21 日至今，任南方稳利基金经理；2017 年 12 月 15 日至今，任南方通利基金经理；2018 年 4 月 12 日至今，任南方涪利基金经理；2018 年 11 月 21 日至今，任南方吉元短债基金经理；2019 年 2 月 26 日至今，任南方臻元基金经理；2019 年 7 月 31 日至今，任南方恒新 39 个月基金经理；2020 年 4 月 29 日至今，任南方远利基金经理；2020 年 6 月 19 日至今，任南方荣尊基金经理；2022 年 1 月 27 日至今，任南方通元 6 个月持有债券基金经理。 |
|--|--|--|--|--|

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。

## 4.2 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 2 次，是由于投资组合的投资策略需要以及接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度经济形势较为复杂。外部地缘政治形势恶化，国内疫情出现扩散，经济出现了内需放缓叠加外部输入性通胀的压力。政策上，金稳会定调稳增长继续加码，稳定了市场预期，但政策的实施路径和出台节奏仍需观察。市场层面，一季度债券市场收益率震荡为主，信用债整体表现不及同期利率债。

投资运作上，债券部分，组合整体维持积极久期，3 月末考虑到市场阶段性调整后性价比更高，进一步增加仓位及久期；权益部分，考虑到稳增长政策出台预期，组合年初维持相对积极的仓位，后续考虑到地缘政治风险变化、外围加息周期加速、市场资金偏好转弱，组合于 3 月逐渐减仓，适当降低风险敞口。

展望未来，经济依然面临需求收缩、供给冲击和预期转弱的三重压力。内需的压力主要体现在地产投资持续低迷，同时疫情防控难度大；外需压力则体现在地缘政治形势复杂，以及全球流动性趋于收紧。通胀方面，目前的主要问题依然在海外，输入性通胀风险需要警惕。政策方面，预计货币政策继续坚持“以我为主”，将采取较为积极的政策来应对国内的压力。利率债策略：货币政策环境较为友好，稳增长预期或逐步增强，预计利率债维持区间震荡。对利率债看法中性。信用债策略：关注地产和城投的政策风险，严防信用风险。权益市场方面，重点挖掘有基本面支持且估值合理的品种择优配置。

#### 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 1.2510 元，报告期内，份额净值增长率为-2.69%，同期业绩基准增长率为-2.17%；本基金 C 份额净值为 1.2166 元，报告期内，份额净值增长率为-2.83%，同期业绩基准增长率为-2.17%。

#### 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              | 68,904.00      | 0.04         |
|    | 其中：股票             | 68,904.00      | 0.04         |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 165,449,934.63 | 96.95        |
|    | 其中：债券             | 165,449,934.63 | 96.95        |
|    | 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      | 2,128,761.38   | 1.25         |
| 8  | 其他资产              | 3,006,050.25   | 1.76         |
| 9  | 合计                | 170,653,650.26 | 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              | -         | -            |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -         | -            |
| E  | 建筑业              | -         | -            |
| F  | 批发和零售业           | -         | -            |
| 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  | -         | -            |
| J  | 金融业              | -         | -            |
| 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       | -         | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 68,904.00 | 0.04         |
| 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 | 68,904.00 | 0.04 |
|----|-----------|------|

## 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  | 000888 | 峨眉山 A | 8,800 | 68,904.00 | 0.04         |

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      | 30,043,208.20  | 18.22        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 130,236,370.27 | 78.99        |
|    | 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      | 5,170,356.16   | 3.14         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 165,449,934.63 | 100.35       |

## 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  | 220003  | 22 付息国债 03   | 200,000 | 20,001,331.49 | 12.13        |
| 2  | 2028034 | 20 浦发银行二级 03 | 150,000 | 15,803,151.78 | 9.58         |
| 3  | 2128030 | 21 交通银行二级    | 150,000 | 15,388,200.00 | 9.33         |
| 4  | 2128025 | 21 建设银行二级 01 | 150,000 | 15,331,413.70 | 9.30         |
| 5  | 2028024 | 20 中信银行二级    | 120,000 | 12,510,108.49 | 7.59         |

## 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 20 广发银行二级 01（证券代码 2028044）、20 浦发银行二级 03（证券代码 2028034）、20 中国银行二级 01（证券代码 2028038）、20 中信银行二级（证券代码 2028024）、21 建设银行二级 01（证券代码 2128025）、21 交通银行二

级（证券代码 2128030）、21 邮储银行二级 01（证券代码 2128028）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、20 广发银行二级 01（证券代码 2028044）

处罚时间：2022 年 3 月 21 日 处罚理由：一、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差；二、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；三、漏报贸易融资业务 EAST 数据等。 处罚结果：对广发银行罚款合计 420 万元。

2、20 浦发银行二级 03（证券代码 2028034）

处罚时间：2022 年 3 月 21 日 处罚理由：一、漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；二、漏报贸易融资业务 EAST 数据；三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据等 处罚结果：罚款 420 万元

浦发银行 2021 年 4 月 30 日公告称，因 2016 年 5 月至 2019 年 1 月，该行未按规定开展代销业务，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对公司责令改正，并处罚款共计 760 万元。

浦发银行 2021 年 7 月 16 日公告称，因监管发现的问题屡查屡犯、配合现场检查不力等原因，中国银行保险监督管理委员会对公司罚款 6920 万元。

3、20 中国银行二级 01（证券代码 2028038）

处罚时间：2022 年 3 月 21 日 处罚理由：一、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差；二、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；三、漏报贷款核销业务 EAST 数据等 处罚结果： 罚款 480 万元

2021 年 5 月 17 日，中国银行股份有限公司因向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款；违规向关系人发放信用贷款等 36 项原因，被处罚 罚没 8761.355 万元

4、20 中信银行二级（证券代码 2028024）

处罚时间：2022 年 3 月 21 日 处罚理由：一、漏报抵押物价值 EAST 数据；二、未报送权益类投资业务 EAST 数据；三、漏报跟单信用证业务 EAST 数据等 处罚结果： 罚款 290 万元

5、21 建设银行二级 01（证券代码 2128025）

处罚时间：2022 年 3 月 21 日 处罚理由：一、贸易融资业务 EAST 数据存在偏差；二、贷款核销业务 EAST 数据存在偏差；三、漏报抵押物价值 EAST 数据等 处罚结果： 罚款 470 万元

2021 年 8 月 13 日，中国建设银行股份有限公司因占压财政存款或资金等 2 项违规行为，被中国人民银行处以警告并处罚款 388 万元。

6、21 交通银行二级（证券代码 2128030）

处罚时间：2022 年 3 月 21 日 处罚理由：一、漏报不良贷款余额 EAST 数据；二、贸易融资业务 EAST 数据存在偏差；三、漏报贷款核销业务 EAST 数据等 处罚结果： 罚款 420 万元

交通银行 2021 年 7 月 16 日公告称，因理财业务和同业业务制度不健全、理财业务数据与事实不符等原因，中国银行保险监督管理委员会对公司处以罚款 4100 万元。交通银行 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处以罚款 62 万元的处分。

#### 7、21 邮储银行二级 01（证券代码 2128028）

处罚时间：2022 年 3 月 21 日 处罚理由：一、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；二、漏报贷款核销业务 EAST 数据；三、漏报抵押物价值 EAST 数据等 处罚结果：罚款 370 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   | 91,848.13    |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,912,141.34 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 2,060.78     |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,006,050.25 |

### 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

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

| 项目                        | 南方荣尊 A         | 南方荣尊 C        |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 142,408,061.64 | 16,230,200.88 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 28,795,377.11  | 1,274,194.33  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 46,059,304.69  | 10,663,004.42 |
| 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               | 125,144,134.06 | 6,841,390.79  |

## § 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

单位：份

| 项目                       | 份额           |
|--------------------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 9,341,367.71 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -            |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -            |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 9,341,367.71 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 7.08         |

### 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              | 20220101-20220314        | 39,032,882.72 | -    | 39,032,882.72 | -          | -    |

|    |   |   |               |              |              |               |        |
|----|---|---|---------------|--------------|--------------|---------------|--------|
| 机构 | 2 | 20220315-<br>20220331;<br>20220101-<br>20220105 | 32,308,128.19 | 799,642.29   | -            | 33,107,770.48 | 25.08% |
| 机构 | 3 | 20220101-<br>20220331                           | 59,096,800.08 | 7,590,056.92 | 7,808,081.16 | 58,878,775.84 | 44.61% |

**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、《南方荣尊混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方荣尊混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、南方荣尊混合型证券投资基金 2022 年 1 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>