

南方兴润价值一年持有期混合型证券 投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 10 月 26 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南方兴润价值一年持有混合
基金主代码	011363
交易代码	011363
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 3 日
报告期末基金份额总额	11,490,075,087.73 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，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，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。投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、金融衍生品投资策略和资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+上证国债指数收益率×40%
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	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方兴润价值一年持有混合 A	南方兴润价值一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	011363	011364
报告期末下属分级基金的份额总额	8,999,451,447.32 份	2,490,623,640.41 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（2022 年 7 月 1 日—2022 年 9 月 30 日）	
	南方兴润价值一年持有混合 A	南方兴润价值一年持有混合 C
1.本期已实现收益	-162,019,666.99	-46,856,133.17
2.本期利润	-236,994,433.51	-68,353,313.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0255	-0.0269
4.期末基金资产净值	6,700,636,224.72	1,836,077,798.29
5.期末基金份额净值	0.7446	0.7372

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

南方兴润价值一年持有混合 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	-3.46%	0.89%	-9.18%	0.53%	5.72%	0.36%
过去六个月	2.38%	0.98%	-5.34%	0.70%	7.72%	0.28%
过去一年	-11.68%	0.99%	-12.45%	0.71%	0.77%	0.28%

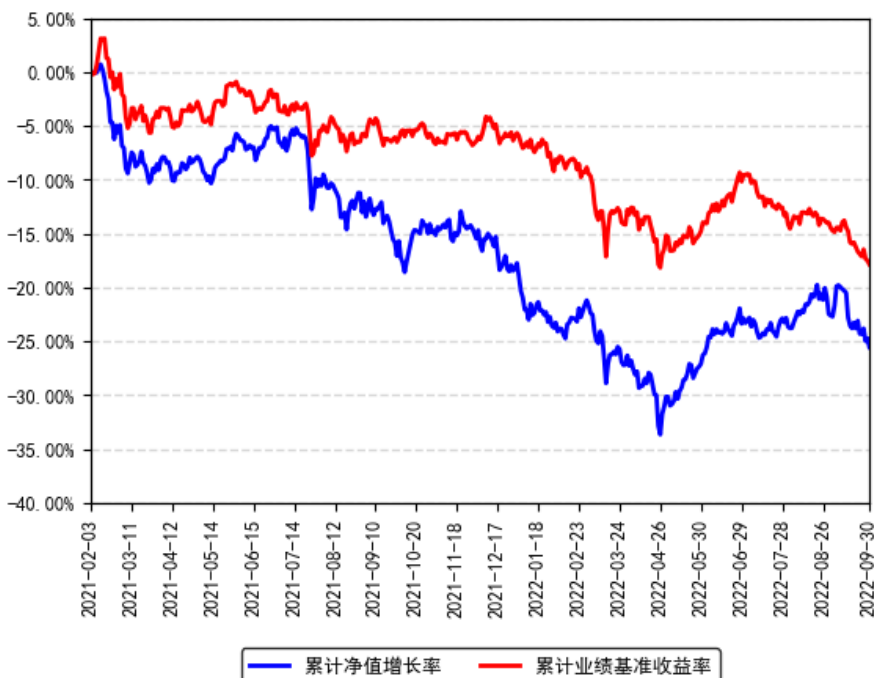
自基金合同生效起至今	-25.54%	0.95%	-17.84%	0.72%	-7.70%	0.23%
------------	---------	-------	---------	-------	--------	-------

南方兴润价值一年持有混合 C

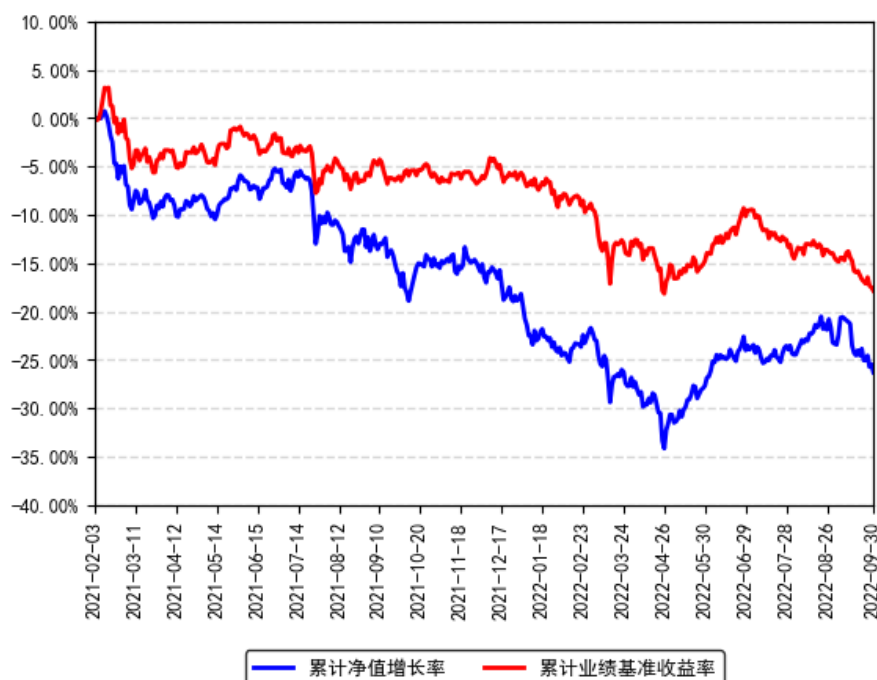
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.61%	0.89%	-9.18%	0.53%	5.57%	0.36%
过去六个月	2.06%	0.98%	-5.34%	0.70%	7.40%	0.28%
过去一年	-12.22%	0.99%	-12.45%	0.71%	0.23%	0.28%
自基金合同生效起至今	-26.28%	0.95%	-17.84%	0.72%	-8.44%	0.23%

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

南方兴润价值一年持有混合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



南方兴润价值一年持有混合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		
史博	本基金基金经理	2021年2月3日	-	24年	硕士研究生学历，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。曾任职于博时基金管理有限公司、中国人寿资产管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司。2004年7月23日至2005年2月25日，任泰达周期基金经理；2007年7月26日至2009年5月23日，任泰达首选基金经理；2008年8月5日至2009年9月25日，任泰达市值基金经理；2009年4月9日至2009年9月25日，任泰达品质基金经理。2009年10月加入南方基金，曾任研究部总监、总裁助理、首席投资官（权益），现任南方基金副总裁。2014年2月26日至2018年11月16日，任南方新优享基金经理；2015年9月11日至2018年11月28日，任南方消费活力基金经理；2017年3月27日至2020

				<p>年 7 月 24 日,任南方智慧混合基金经理; 2018 年 5 月 10 日至 2020 年 7 月 24 日,任南方瑞祥一年混合基金经理; 2019 年 3 月 12 日至 2020 年 11 月 20 日,任南方智诚混合基金经理; 2011 年 2 月 17 日至今,任南方绩优基金经理; 2018 年 9 月 6 日至今,任南方瑞合基金经理; 2021 年 2 月 3 日至今,任南方兴润价值一年持有混合基金经理; 2021 年 2 月 10 日至今,兼任投资经理; 2021 年 8 月 25 日至今,任南方新能源产业趋势混合基金经理; 2021 年 12 月 28 日至今,任南方港股创新视野一年持有混合基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
史博	公募基金	5	15,778,327,431.43	2004 年 07 月 23 日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	1	31,192,207,034.23	2018 年 08 月 24 日
	合计	6	46,970,534,465.66	-

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

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

回顾 2022 年第三季度 A 股市场以及港股市场主要指数表现：A 股市场中，沪深 300 指数下跌 13.94%，创业板指数下跌 17.32%；港股市场中，恒生指数下跌 21.7%，恒生科技指数下跌 30.12%。第三季度全球主要市场指数均呈现出下跌的走势，中国市场表现整体弱于全球其他主要市场，其中美国标普 500 指数下跌 6.11%，纳斯达克指数下跌 4.11%。截止 9 月 30 日，三季度南方兴润基金净值下跌 3.46%，同期基金业绩基准为-9.18%，跑赢业绩基准 5.72 个百分点。其中，组合整体超额收益归因分析得到行业配置收益为-1.06%，而选股贡献了组合的主要超额收益+6.44%。南方兴润价值基金中港股仓位收益为-2.84%，港股基准收益为-29.74%，跑赢了港股基准约为 26.9 个百分点，港股超额收益主要来源于行业配置部分。第三季度南方兴润价值基金组合仓位略微有所增长，股票仓位在 65%左右。其中，港股持仓权重约为 20%，A 股持仓权重约为 45%。其中，A 股整体持仓偏向于以新能源为代表的高端制造业，超额收益按行业划分，产生正贡献的前三大行业分别是家用电器，非银金融以及电气设备，产生负贡献的前三大行业分别是医药生物，化工以及电子。

与上季度相比，A 股和港股市场的表现落后于全球主要股票市场，呈现出单边下行的走势，特别是香港市场三季度呈现大幅回撤，三大主要市场指数-恒生指数/恒生国企指数/恒生科技指数出现了单季度 20%以上的回撤，回撤幅度之大港股历史上也较为罕见。管理人认为 A 股和港股市场呈现单边下行走势的原因主要有以下五点，主要为外部因素，也包含一定的内部因素，同时也反映出市场的结构因素。外部因素为（1）二季度全球市场投资者对于美国通胀水平回落的预期过于乐观，在能源价格高企的背景下，市场逐步意识到只有通过超预期的紧缩货币政策才能遏制当前较高的通胀水平。因此，全球资产定价的锚——10 年期美债收益率在三季度出现了快速上升，使得新兴市场的回撤幅度较为严重；（2）在“俄乌冲突”的阴霾下，欧洲能源价格高企，成本输入型通胀使得欧洲整体表现出滞胀的宏观经济特征，能源化工行业的停摆，居民用电成本的高企，乘用车消费需求的低景气度加重了外围市场的不确定性，投资者相对更加谨慎。（3）美联储加息收紧全球流动性的背景下，8 月 12 号开始在岸人民币兑美元汇率从 6.7349 贬值至 9 月 28 日 7.2458，在短期内呈现出单边贬

值的走势,使得市场进一步担心中国后疫情时代经济复苏力度以及房地产行业头部企业的信用违约情况。内部自身因素为(1)市场今年持续担心防疫政策的决心与经济诉求难以兼得,疫情的防控时间和管控的力度超出市场预期,使得消费行业在复苏力度上呈现较弱的表现。同时,国内部分民营地产公司由于早年的激进扩张叠加快周转的商业模式,在“三条红线”等行业监管政策下相继暴雷。尽管部分城市地产政策已经陆续放松,但居民加杠杆的意愿上略显不足。市场结构性因素主要是在 19-21 年市场对于优质白马公司的追捧使得这些核心资产普遍交易在较高的估值水平,未来的预期收益率水平不足,而当通胀环境中无风险利率水平上行推升了资本成本的上升,使得投资者需要重新寻找更具性价比的权益资产。因此,在海外需求走弱,新冠疫情持续反复以及地缘政治冲突的宏观逆周期环境中,市场对逆周期调节经济的手段略显信心不足。同时,尽管核心资产经历了一定程度的回调,但是估值水平仍然较高,因此在一个相对避险的投资环境中,市场呈现出单边下行的走势。

复盘 2022 年三季度 A 股和港股市场的表现,A 股和港股市场主要指数领跌于全球市场。主要因为二季度 A 股和港股表现较好,尤其是 A 股新能源行业和公司从底部反弹接近一倍的空间,行业估值重新回到了较高水平。其中,A 股市场中第三季度表现最好的五个申万一级行业分别是煤炭(+0.96%),综合(+0.21%),公用事业(-4.39%),石油石化(-4.93%)以及交通运输(-5.32%);港股市场中第三季度表现最好的三个恒生一级行业分别是电讯(-2.27%),必选消费(-13.96%)以及可选消费(-23.11%),而表现最差的三个恒生以及行业分别是资讯科技(-27.28%),医疗保健(-27.64%),工业(-30.57%)。第三季度中无论是 A 股市场还是港股市场具备高股息,低估值,防守属性的行业表现较好。

展望 2022 年第四季度权益市场,结合 9 月 30 日针对房地产行业出台的信用支持政策,管理人依然相信尽管面对全球通胀高企的环境,国内新冠疫情发展的复杂多变以及区域地缘政治矛盾冲突的加剧,发展好自身经济依然是我们国家发展中最为重要任务之一。当前尽管国内面临的经济下行压力,但是国内有充足的货币,财政以及政策性工具可以有效提振经济基本面。针对当前的宏观环境,展望 A 股以及港股市场中的投资机会更重要的是关注市场结构变化而非整体走势,关注资产的估值性价比而非景气度,关注公司的现金流稳健性而非利润增长速度,关注公司的动态变化而非静态的壁垒。我们一直认为投资过程中敏锐的观察,持续深度思考,以及平衡的投资策略是投资人在当下复杂多变的宏观环境中依然能够保持内心宁静的重要手段。复盘新中国成立以来的历史发展,可以看到中国社会的发展呈现处螺旋发展的走势,具有非常强的韧性,一代人有一代人的历史使命,总能在曲折中谋求发展。与此同时,股票市场也在一轮一轮周期中不断成熟,市场对于资产的定价越来越有效。

2022 年四季度的权益市场,管理人认为依然需要重点关注市场两类资产的周期变化,而这两种周期将对全球市场的结构以及风格产生比较重要的影响。两类资产的周期分别是(1)以原油为代表的大宗商品周期;(2)以房地产为代表的国内地产周期;这两类资产将

分别影响海外的通胀水平下行的速度，美债利率的走势以及国内的信贷扩张以及经济恢复的速度。

南方兴润基金三季度风格较为稳定，换手率保持较低水平。管理人依然在符合当前中国实体产业转型升级的方向上通过“自下而上”来精选个股。当前需要更加关注国内以及海外宏观范式发生的变化。自上世纪 80 年代以来，全球通过产业链的分工合作，科技水平的持续进步，贸易深度和广度的持续扩张，进入了低增长，低通胀，低利率，低摩擦岁月静好的“四低时代”时代。但是，随着 2018 年以来中美两国关系持续紧张，以俄乌为代表的地区局部战争逐步升级，新冠疫情对全球供应链形成冲击，以及泛滥流通性带来的高通胀，过往的宏观假设逐步转变为高通胀，高利率以及高摩擦的时代。历史中每一轮中长期的时代变迁有望催生出新的具备吸引力的资产类别以及新的股票投资策略。南方兴润价值基金的组合中不仅仅投资具备优秀商业模式的公司，同时也前瞻性地寻找不断通过技术创新进步来构建自己壁垒的公司。

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 0.7446 元，报告期内，份额净值增长率为-3.46%，同期业绩基准增长率为-9.18%；本基金 C 份额净值为 0.7372 元，报告期内，份额净值增长率为-3.61%，同期业绩基准增长率为-9.18%。

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	5,609,829,646.87	65.58
	其中：股票	5,609,829,646.87	65.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,933,473.59	0.03
	其中：债券	2,933,473.59	0.03
	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	2,941,042,753.76	34.38
8	其他资产	61,286.98	0.00
9	合计	8,553,867,161.20	100.00

注：本基金本报告期末通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 1,703,186,115.05 元，占基金资产净值比例 19.95%。

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	77,456,782.08	0.91
B	采矿业	220,054,702.00	2.58
C	制造业	3,160,901,552.54	37.03
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	187,095,881.34	2.19
G	交通运输、仓储和邮政业	60,217,034.84	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	124,520,890.80	1.46
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	27,410,969.58	0.32
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	48,985,718.64	0.57
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	3,906,643,531.82	45.76

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	1,057,890,772.49	12.39
工业	-	-
非必需消费	146,776,344.46	1.72
必需消费品	46,326,863.90	0.54

医疗保健	25,517,273.23	0.30
金融	-	-
科技	-	-
通讯	410,313,541.37	4.81
公用事业	-	-
房地产	16,361,319.60	0.19
政府	-	-
合计	1,703,186,115.05	19.95

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

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	01171	兖矿能源	24,512,000	632,943,030.14	7.41
2	300316	晶盛机电	8,208,090	555,031,045.80	6.50
3	00941	中国移动	9,091,500	410,313,541.37	4.81
4	002258	利尔化学	17,475,528	330,287,479.20	3.87
5	601058	赛轮轮胎	28,021,404	283,576,608.48	3.32
6	688032	禾迈股份	252,861	277,714,707.69	3.25
7	000661	长春高新	1,486,932	253,298,866.20	2.97
8	01378	中国宏桥	38,498,000	226,324,352.28	2.65
9	300776	帝尔激光	1,275,012	221,099,830.92	2.59
10	000983	山西焦煤	14,689,900	220,054,702.00	2.58

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）	2,933,473.59	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,933,473.59	0.03

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	127072	博实转债	29,333	2,933,473.59	0.03

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本，以达到降低投资组合整体风险的目的。

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。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	61,286.98
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,286.98

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	南方兴润价值一年持有混合 A	南方兴润价值一年持有混合 C

报告期期初基金份额总额	9,596,058,188.82	2,603,152,511.82
报告期期间基金总申购份额	4,436,892.75	1,533,218.00
减：报告期期间基金总赎回份额	601,043,634.25	114,062,089.41
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	8,999,451,447.32	2,490,623,640.41

§ 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、《南方兴润价值一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方兴润价值一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、南方兴润价值一年持有期混合型证券投资基金 2022 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>