

南方优势产业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 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：2023 年 1 月 20 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2023年1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10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 南方优势产业灵活配置混合（LOF） |
| 场内简称 | 南方优势产业 LOF |
| 基金主代码 | 160142 |
| 交易代码 | 160142 |
| 基金运作方式 | 上市型开放式（LOF） |
| 基金合同生效日 | 2021年8月3日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,519,881,599.46 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 | 本基金立足于分享国家优势产业的长期成长空间。国家优势产业包括但不限于互联网、云计算、大数据、人工智能、创新药、新兴消费等。主要投资策略包括：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、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×20%+上证国债指数收益率×30% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，一般而言，其预期风险收益水平高于债券基金与货币市场型基金，低于股票型基金。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 | 中国工商银行股份有限公司 |

§ 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10月1日—2022年12月31日） |
|----------------|-----------------------------|
| 1.本期已实现收益 | -204,036,024.76 |
| 2.本期利润 | -52,147,135.17 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0336 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,513,704,246.73 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9959 |

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。

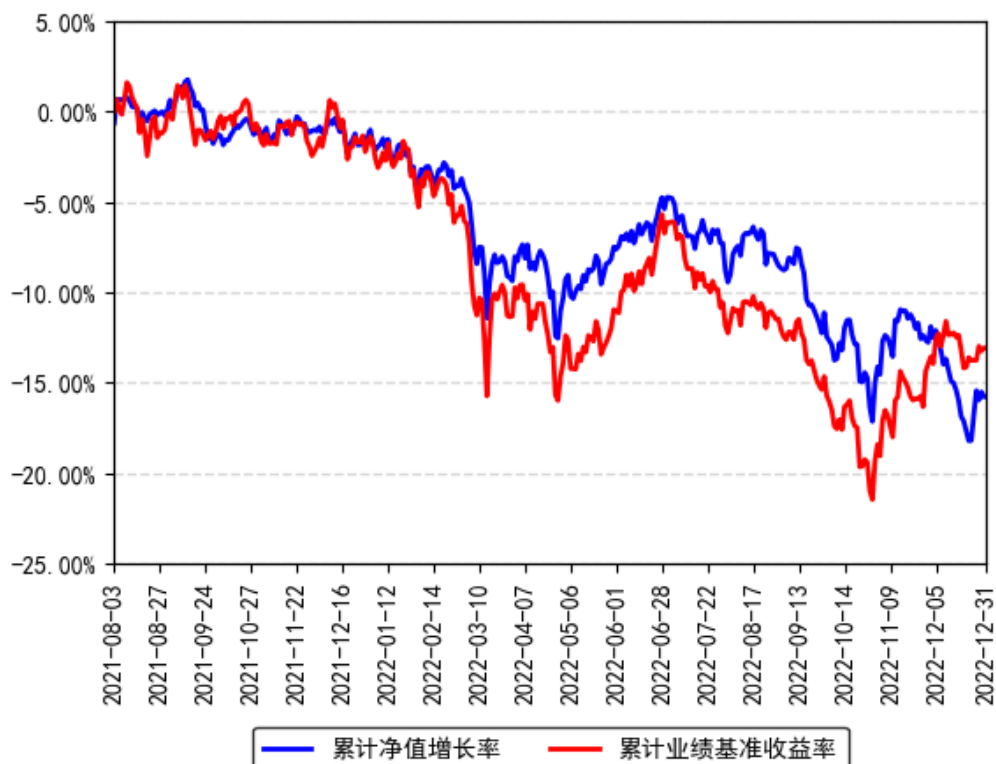
3.2 基金净值表现

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

| 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 | -3.29% | 0.92% | 4.11% | 0.99% | -7.40% | -0.07% |
| 过去六个月 | -11.59% | 0.79% | -7.39% | 0.83% | -4.20% | -0.04% |
| 过去一年 | -14.92% | 0.78% | -11.86% | 0.94% | -3.06% | -0.16% |
| 自基金合同生效起至今 | -15.79% | 0.69% | -13.09% | 0.85% | -2.70% | -0.16% |

3.2.2 自基金转型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

南方优势产业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



注：本基金转型日期为 2021 年 8 月 3 日，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 | | |
| 张延闽 | 本基金基金经理 | 2022 年 11 月 11 日 | - | 12 年 | 哈尔滨工业大学控制科学与工程硕士，具有基金从业资格。曾就职于融通基金管理有限公司，历任研究员、基金经理、权益投资部总经理。2014 年 10 月 25 日至 2016 年 8 月 11 日，任基金通乾基金经理；2015 年 1 月 16 日至 2019 年 4 月 12 日，任融通转型三动力灵活配置混合基金经理；2016 年 8 月 12 日至 2020 年 1 月 2 日，任融通通乾研究精选混合基金经理；2017 年 2 月 17 日至 2020 年 1 月 2 日，任融通新蓝筹混合基金经理；2018 年 2 月 11 日至 2019 年 11 月 30 日，任 |

| | | | | | |
|----|--------------|-----------|-------------|-----|---|
| | | | | | 融通逆向策略灵活配置混合基金经理；2018年12月5日至2019年12月11日，任融通研究优选混合基金经理。2020年1月加入南方基金；2020年5月29日至今，任南方积配、南方中国梦基金经理；2021年8月20日至今，任南方高增基金经理；2022年11月11日至今，任南方优势产业混合基金经理 2022年11月21日至今，兼任投资经理。 |
| 李璇 | 本基金基金经理（已离任） | 2021年8月3日 | 2022年11月11日 | 15年 | 女，清华大学金融学学士、硕士，特许金融分析师（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21日至2012年6月7日，任南方宝元基金经理；2012年12月21日至2014年9月19日，任南方安心基金经理；2015年12月30日至2017年2月24日，任南方润元基金经理；2013年7月23日至2017年9月21日，任南方稳利基金经理；2016年8月5日至2017年12月15日，任南方通利基金经理；2016年8月10日至2017年12月15日，任南方荣冠基金经理；2016年8月5日至2018年2月2日，任南方丰元基金经理；2016年11月23日至2018年2月2日，任南方荣安基金经理；2017年1月25日至2018年7月27日，任南方和利基金经理；2017年3月24日至2018年7月27日，任南方荣优基金经理；2017年5月22日至2018年7月27日，任南方荣尊基金经理；2017年6月15日至2018年7月27日，任南方荣知基金经理；2017年7月13日至2018年7月27日，任南方荣年基金经理；2016年9月29日至2019年3月29日，任南方多元基金经理；2010年9月21日至2019年5月24日，任南方多利基金经理；2016年12月21日至2019年5月24日，任南方睿见混合基金经理；2017年1月18日至2019年5月24日，任南方宏元基金经理；2019年1月10日至2020年7月31日，任南方国利基金经理；2018年7月13日至2021年8月3日，任南方配售基金经理；2021年8 |

| | | | | | |
|----|--------------|-----------|-------------|-----|---|
| | | | | | 月3日至2022年11月11日，任南方优势产业混合基金经理；2012年5月17日至今，任南方金利基金经理；2017年9月12日至今，任南方兴利基金经理；2020年9月4日至今，任南方多利基金经理；2021年8月27日至今，任南方交元基金经理；2022年7月22日至今，任南方丰元基金经理。 |
| 茅炜 | 本基金基金经理（已离任） | 2021年8月3日 | 2022年11月11日 | 14年 | 上海财经大学保险学学士，具有基金从业资格。曾任职于东方人寿保险公司及生命人寿保险公司，担任保险精算员，在国金证券研究所任职期间，担任保险及金融行业研究员。2009年加入南方基金，历任研究部保险及金融行业研究员、研究部总监助理、副总监、执行总监、总监、权益研究部总经理，现任首席投资官（权益）兼权益投资部总经理、董事总经理、资产配置委员会主席、境内权益投资决策委员会主席；2012年10月12日至2016年1月26日，兼任专户投资管理部投资经理；2018年2月2日至2020年2月7日，任南方教育股票基金经理；2018年6月8日至2020年4月10日，任南方医保基金经理；2016年2月3日至2020年5月15日，任南方君选基金经理；2019年12月6日至2020年11月17日，任南方消费基金经理；2019年3月29日至2020年11月20日，任南方军工混合基金经理；2020年2月7日至2021年6月18日，任南方高端装备基金经理；2020年11月17日至2021年6月18日，任南方消费基金经理；2019年12月20日至2021年8月3日，任南方配售基金经理；2020年7月28日至2021年10月15日，任科创板基金基金经理；2019年5月6日至2022年1月27日，任南方科技创新混合基金经理；2021年8月3日至2022年11月11日，任南方优势产业混合基金经理；2021年9月7日至2022年11月11日，任南方均衡优选一年持有期混合基金经理；2018年5月30日至今，任南方君信混合基金经理；2019年6月19日至今，任南方信息创新混合基金经理；2020年6月12日至 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 今，任南方成长先锋混合基金经理；2020 年 8 月 4 日至今，任南方景气驱动混合基金经理；2022 年 8 月 23 日至今，任南方高质量优选混合基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

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 |
|-----|----------|---------|------------------|------------------|
| 张延闽 | 公募基金 | 4 | 3,842,697,279.75 | 2014 年 10 月 25 日 |
| | 私募资产管理计划 | - | - | - |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 4 | 3,842,697,279.75 | - |

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 8 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

2022 年第 4 季度，本基金收益率为-3.29%，同期沪深 300，创业板指，万得全 A 的收益率分别为 1.75%，2.53%，2.89%。本基金在 4 季度的整体表现落后市场。主要的原因有三方面。首先，三季报中持仓以价值股为主，受到市场风格影响月度跌幅较大；其次，11 月份更换基金经理后，对组合做了较大幅度的调仓。目前股票仓位以成长股结构为主，短期调仓的效果尚未体现出来。第三，11，12 月港股反弹迅速，而本基金在调仓过程中港股头寸欠配，导致阶段性跑输市场。

2022 年万得全 A 和沪深 300 全年收益率分别是-18.66%和-21.63%，申万 31 个一级行业中只有 2 个获得正收益。且根据天风证券的统计，过去一年 A 股平均每 20-30 个交易日更换一个领涨板块。无论是投资获得感还是体验感都是非常差的年份。今年市场给我们的一个经验和教训是“预期“大幅跑在”现实“之前，对基金经理交易敏锐度提出了异常高的要求。这种“极致内卷“的套利行情着实让人焦虑，个人认为主要原因是在三年疫情反复的压力测试下，上市公司整体盈利呈现出非常大的下行压力。一方面 EPS 端的亮点乏善可陈，另一方面稳经济大盘背景下市场的流动性却并不差，导致估值（PE）的波动异常频繁。

展望 2023 年，我们认为市场这种“内卷”的程度有希望边际改善。四季度末一些积极的因素在快速变化，地产和防疫政策先后转向对于改变市场预期，修复投资者风险偏好将起到非常正面的作用。因此，中期来看基本面最坏的时候大概率已经过去了。过去困扰定价的业绩锚在未来将逐季改善，而投资者可以通过提高资产判断的前瞻性来降低换手焦虑。

本基金在未来会从胜率和赔率两个角度评估资产，并通过逆向选股，组合投资的方式力争实现超越市场的回报。逆向投资有两层含义，第一层是价格低于价值之后的周期性均值回归，第二层是提前看到企业更大的长期成长空间。因此我们的组合将立足于三个方向寻找机会：传统行业的周期反转，新的技术趋势，新的消费习惯。第一部分的周期反转资产预计在组合里的权重不超过 20%，我们不会为了配置而配置，还是在研究覆盖过的资产里面寻找机会。我们会花 80%的精力在成长股里“数星星，翻石头”，就像罗斯福所说“一个人仅有投身于伟大的时代洪流中，他的生命才会闪烁出光彩”。目前组合里面 A 股高端制造业的占比最高，我们认为这部分企业会顺周期和经济同步复苏，并且迎来超越市场平均水平的增长。组合当前的持仓中在大消费板块和港股整体欠配，这是后面需要努力补足的短板。我们一直希望能发掘基本面和股价同时逆向的投资机会。然而过去三年部分行业虽然疫情受损严重，股票价格却交易在新高附近，即便消费复苏到 2019 年的水平，股票的赔率也略显不足。港股方面，随着政策日趋友好，监管最大的不确定性已经消除，企业经营向常态化转向，股票也会真实反映基本面的状况。本基金预留了一部分仓位，将择机增加港股的配置头寸。

2023 年中国经济弱复苏叠加海外衰退预期，注定也是不平静的一年。我们不做过多的宏观预判，也不奢望市场先生的慈眉善目，随着做投资的时间渐长，最大的体会是“发上等愿，结中等缘，享下等福”。新的一年怀着对美好生活的憧憬，同时如履薄冰地谨慎前行。做好自己，努力提高选股胜率，力争获得更优的投资回报。

最后，感谢各位投资人的托付！2023，赤兔呈瑞，同愿同行！

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0.9959元，报告期内，份额净值增长率为-3.29%，同期业绩基准增长率为4.11%。

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 | 1,292,183,264.43 | 79.05 |
| | 其中：股票 | 1,292,183,264.43 | 79.05 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 87,363,535.04 | 5.34 |
| | 其中：债券 | 87,363,535.04 | 5.34 |
| | 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 | 114,117,000.00 | 6.98 |
| | 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 | 140,721,453.48 | 8.61 |
| 8 | 其他资产 | 244,082.69 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 1,634,629,335.64 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股市值为人民币55,634,414.35元，占基金资产净值比例3.68%；通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币24,851,820.99元，占基金资产净值比例1.64%。

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 | 37,466,683.50 | 2.48 |
| B | 采矿业 | 1,276,860.80 | 0.08 |
| C | 制造业 | 940,972,158.11 | 62.16 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,199,000.00 | 0.34 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 2,866,506.00 | 0.19 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 53,561,278.50 | 3.54 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 126,800,808.85 | 8.38 |
| J | 金融业 | 18,010,584.58 | 1.19 |
| K | 房地产业 | 10,149,744.00 | 0.67 |
| L | 租赁和商务服务业 | 201,799.00 | 0.01 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,906,355.12 | 0.19 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 8,616,070.05 | 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 | 3,669,180.58 | 0.24 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,211,697,029.09 | 80.05 |

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 | - | - |
| 工业 | 2,231,227.67 | 0.15 |
| 非必需消费 | 1,512,976.06 | 0.10 |
| 必需消费品 | 39,669,763.39 | 2.62 |
| 医疗保健 | 11,280,280.56 | 0.75 |
| 金融 | 5,421,791.59 | 0.36 |
| 科技 | - | - |
| 通讯 | 3,543,669.08 | 0.23 |
| 公用事业 | - | - |
| 房地产 | 16,826,526.99 | 1.11 |
| 政府 | - | - |
| 合计 | 80,486,235.34 | 5.32 |

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 | 002049 | 紫光国微 | 889,877 | 117,303,586.14 | 7.75 |
| 2 | 600150 | 中国船舶 | 4,204,873 | 93,684,570.44 | 6.19 |
| 3 | 600685 | 中船防务 | 3,862,100 | 80,177,196.00 | 5.30 |
| 4 | 00317 | 中船防务 | 338,000 | 2,231,227.67 | 0.15 |
| 5 | 688333 | 铂力特 | 544,634 | 77,746,503.50 | 5.14 |
| 6 | 000733 | 振华科技 | 673,768 | 76,964,518.64 | 5.08 |
| 7 | 603927 | 中科软 | 2,402,480 | 71,137,432.80 | 4.70 |
| 8 | 603960 | 克来机电 | 3,982,600 | 70,611,498.00 | 4.66 |
| 9 | 300833 | 浩洋股份 | 526,100 | 44,108,224.00 | 2.91 |
| 10 | 603181 | 皇马科技 | 3,019,470 | 42,997,252.80 | 2.84 |
| 11 | 603288 | 海天味业 | 505,900 | 40,269,640.00 | 2.66 |

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 | 85,444,189.30 | 5.64 |
| 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） | 1,919,345.74 | 0.13 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 87,363,535.04 | 5.77 |

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 | 019679 | 22 国债 14 | 540,000 | 54,370,232.88 | 3.59 |
| 2 | 019674 | 22 国债 09 | 306,800 | 31,073,956.42 | 2.05 |
| 3 | 118027 | 宏图转债 | 13,960 | 1,707,305.32 | 0.11 |
| 4 | 118025 | 奕瑞转债 | 1,710 | 212,040.42 | 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

本基金在进行股指期货投资时，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、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指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。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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 | 196,394.29 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 47,688.40 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 244,082.69 |

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

| | |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,591,932,465.49 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,300,448.91 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 74,351,314.94 |
| 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 | 1,519,881,599.46 |

§ 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、《南方优势产业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 2、《南方优势产业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 3、南方优势产业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2022 年 4 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>