

南方宝裕混合型证券投资基金 2023 年 第 1 季度报告

2023 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 南方宝裕混合 |
| 基金主代码 | 012945 |
| 交易代码 | 012945 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 2 月 25 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 575,749,465.43 份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票，通过严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将采取自上而下的投资策略对各种投资工具进行合理的配置。在风险与收益的匹配方面，力求降低信用风险，并在良好控制利率风险与市场风险的基础上力争为投资者获取稳定的收益。具体投资策略包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、金融衍生品投资策略；5、资产支持证券投资策略等。 |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+中债综合指数收益率×80% |
| 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的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 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 南方宝裕混合 A | 南方宝裕混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012945 | 012946 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 562,092,924.34 份 | 13,656,541.09 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（2023 年 1 月 1 日—2023 年 3 月 31 日） | |
|----------------|-------------------------------------|---------------|
| | 南方宝裕混合 A | 南方宝裕混合 C |
| 1.本期已实现收益 | 9,822,645.21 | 218,190.92 |
| 2.本期利润 | 25,906,159.60 | 489,767.72 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0306 | 0.0249 |
| 4.期末基金资产净值 | 578,269,068.20 | 13,957,228.45 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0288 | 1.0220 |

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

南方宝裕混合 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 | 2.36% | 0.25% | 1.08% | 0.16% | 1.28% | 0.09% |
| 过去六个月 | 2.73% | 0.25% | 1.71% | 0.21% | 1.02% | 0.04% |
| 过去一年 | 2.89% | 0.21% | 0.40% | 0.22% | 2.49% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.88% | 0.20% | -1.13% | 0.25% | 4.01% | -0.05% |

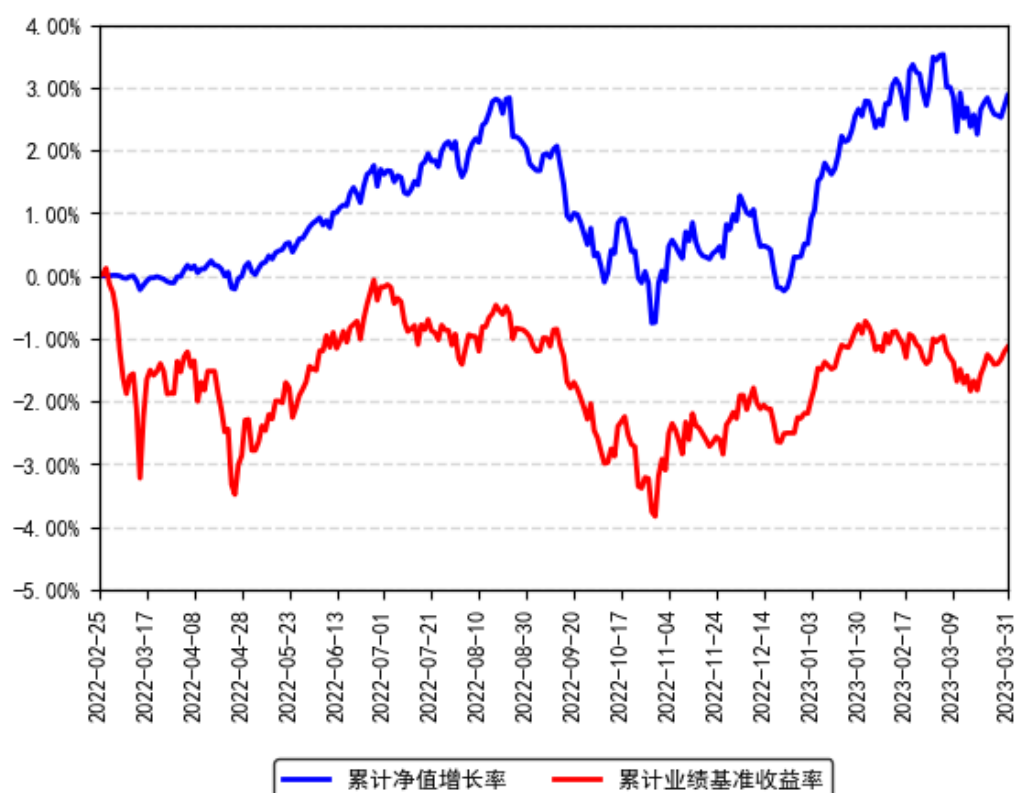
南方宝裕混合 C

| 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 |
|----|-------|-------|-------|-------|-----|-----|
|----|-------|-------|-------|-------|-----|-----|

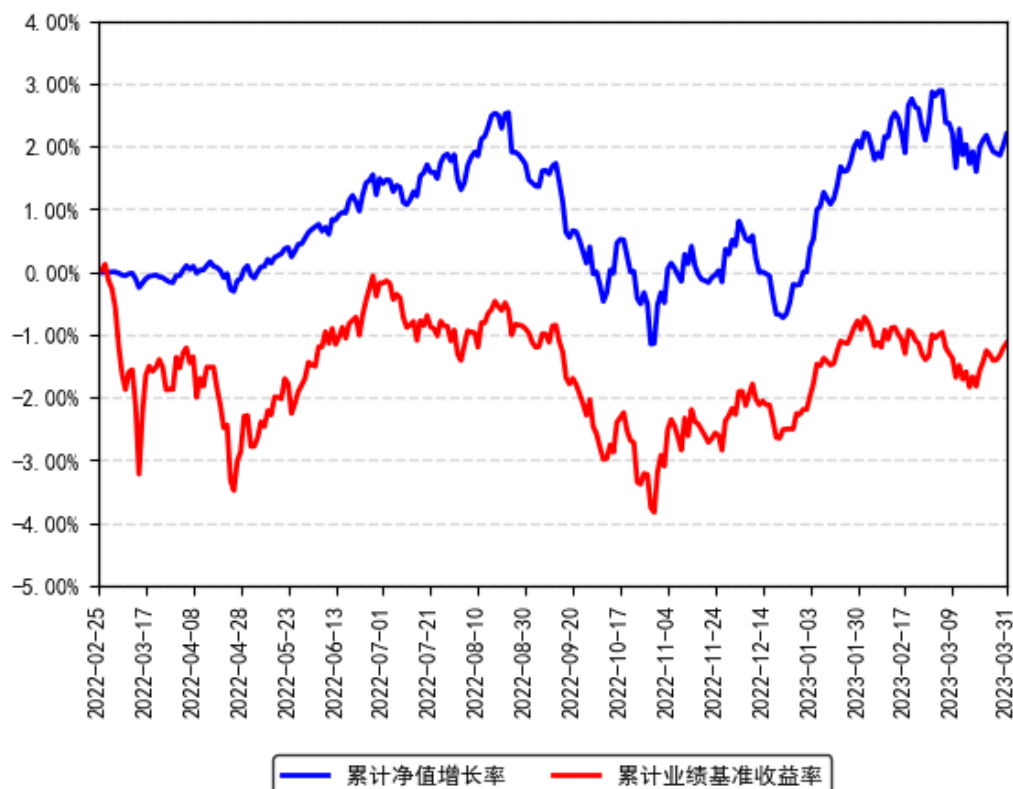
| | 长率① | 长率标准差② | 准收益率③ | 准收益率标准差④ | | |
|------------|-------|--------|--------|----------|-------|--------|
| 过去三个月 | 2.20% | 0.25% | 1.08% | 0.16% | 1.12% | 0.09% |
| 过去六个月 | 2.42% | 0.25% | 1.71% | 0.21% | 0.71% | 0.04% |
| 过去一年 | 2.26% | 0.21% | 0.40% | 0.22% | 1.86% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.20% | 0.20% | -1.13% | 0.25% | 3.33% | -0.05% |

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

南方宝裕混合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



南方宝裕混合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



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 | | |
| 孙鲁闽 | 本基金基金经理 | 2022 年 2 月 25 日 | - | 19 年 | 南开大学理学和经济学双学士、澳大利亚新南威尔士大学商学硕士，具有基金从业资格。曾任职于厦门国际银行福州分行，2003 年 4 月加入南方基金，历任行业研究员、南方高增和南方隆元的基金经理助理、专户投资管理部总监助理、权益投资部副总监，现任联席首席投资官、董事总经理、投顾业务投资决策委员会主席；2007 年 12 月 17 日至 2010 年 12 月 14 日，任投资经理。2011 年 6 月 21 日至 2017 年 7 月 15 日，任南方保本基金经理；2015 年 12 月 23 日至 2017 年 12 月 30 日，任南方瑞利保本基金经 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>理；2015 年 5 月 29 日至 2018 年 6 月 5 日，任南方丰合保本基金经理；2016 年 1 月 11 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方益和保本基金经理；2010 年 12 月 14 日至 2019 年 5 月 30 日，任南方避险基金经理；2018 年 6 月 15 日至 2019 年 7 月 5 日，任南方甌智混合基金经理；2017 年 12 月 30 日至 2019 年 9 月 23 日，任南方瑞利混合基金经理；2018 年 6 月 5 日至 2019 年 9 月 23 日，任南方新蓝筹混合基金经理；2018 年 6 月 8 日至 2019 年 9 月 23 日，任南方改革机遇基金经理；2019 年 1 月 18 日至 2019 年 9 月 23 日，任南方益和混合基金经理；2018 年 11 月 5 日至 2020 年 4 月 1 日，任南方固胜定期开放混合基金经理；2015 年 4 月 17 日至 2020 年 5 月 15 日，任南方利淘基金经理；2015 年 5 月 20 日至 2020 年 5 月 15 日，任南方利鑫基金经理；2017 年 7 月 13 日至 2020 年 5 月 15 日，任南方安睿混合基金经理；2018 年 1 月 29 日至 2020 年 5 月 15 日，任南方融尚再融资基金经理；2019 年 7 月 5 日至 2020 年 5 月 15 日，任南方甌智混合基金经理；2016 年 11 月 15 日至 2021 年 2 月 26 日任南方安裕混合基金经理；2016 年 9 月 22 日至今，任南方安泰混合基金经理；2019 年 5 月 30 日至今，任南方致远混合基金经理；2020 年 3 月 5 日至今，任南方宝丰混合基金经理；2020 年 9 月 11 日至今，兼任投资经理；2021 年 1 月 6 日至今，任南方宁悦一年持有期混合基金经理；2021 年 6 月 8 日至今，任南方宝恒混合基金经理；2021 年 6 月 21 日至今，任南方佳元 6 个月持有债券基金经理；2022 年 2 月 25 日至今，任南方宝裕混合基金经理。</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 |
|----|------|---------|---------|------|
|----|------|---------|---------|------|

| | | | | |
|-----|----------|----|-------------------|------------------|
| 孙鲁闽 | 公募基金 | 7 | 15,652,776,877.50 | 2010 年 12 月 14 日 |
| | 私募资产管理计划 | - | - | - |
| | 其他组合 | 22 | 82,761,364,434.21 | 2007 年 12 月 27 日 |
| | 合计 | 29 | 98,414,141,311.71 | - |

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 3 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

年初以来，国内疫情快速消退，生产生活开始逐步恢复，各类消费场景显著复苏。从一季度的数据上来看，中国制造业 PMI 指数均处于荣枯线以上，较 2022 年四季度有显著改善，3 月份非制造业 PMI 指数为 58.2%，景气度持续回暖。从分项数据上来看修复强度仍有差异，与疫情相关的消费、地产需求明显恢复，出口方面受到海外通胀影响依然偏弱。海外市场方面，美联储在一季度内连续两次加息 25bp。受到美国 1 月份新增非农就业数据以及 1 月美国 CPI 降幅明细放缓等因素影响，市场开始再次预期美联储加息，随后在 3 月中旬美国银行业风险事件爆发，硅谷银行被接管，加息预期才有所回落。受此影响，人民币汇率在一季度

内有所反复，整体略有升值；北向资金方面一季度整体净流入 1,795.1 亿元，创下单季度历史新高。

一季度受到经济基本面恢复以及北向资金快速流入等因素影响，A 股整体呈现上涨态势，上证指数上涨 5.94%，深证成指上涨 6.45%，结构上以科创 50、创业板 50 为代表的成长风格表现较好。从申万一级行业指数上来看，受益于“数字中国建设整体布局规划”政策的推出以及 AIGC 浪潮带来的算力需求以及 AI 应用的爆发，计算机、传媒、通信等板块表现较好，报告期内分别上涨 36.79%、34.24%和 29.51%。房地产、商业贸易、银行等板块表现较差，报告期内分别下跌 6.11%、5.11%、2.70%。固收方面，受经济复苏预期和股市情绪向好影响，1 月债券收益率总体上行。因去年 11 月以来债券收益率上行幅度较大，部分中短期信用债具备配置价值跌幅较小，信用债买盘较多，收益率进一步上行幅度较小。2 月处于数据真空期。尽管经济基本面处于复苏进程中，但房地产市场尤其是三四线城市改善幅度一般，市场高息资产供给较少，债券市场对经济回升这一预期反应的较为充分，而理财规模企稳后配置力量仍存，债券收益率在前期上行后具备一定的配置价值。3 月央行降准，全月资金面呈现紧平衡状态。投资、消费等关键经济指标均有改善，值得注意的是商品房销售面积、新开工面积同比虽然仍处于负值区间，但改善幅度较为明显，竣工面积同比已经转正。通胀方面，CPI 和 PPI 同比低于预期，市场对经济企稳回升进而推高通胀压力的关注有所弱化。金融数据方面，贷款延续了企业强而居民弱的特点。一季度收益率呈现信用债下行、利率债上行的趋势，其中 3 年期 AAA 评级信用债收益率下行 11bp，3、5、10 年期国债收益率分别上行 10bp、4bp 和 2bp。

报告期内本基金权益仓位维持在 30%的中枢水平，在方向配置上我们坚持一贯投资思路，大体保持不变，主要集中在公用事业、食品饮料、电气设备、银行、汽车等业绩增长稳定或低估值相关的行业。固收方面，本基金一季度减持期限较短、静态收益率较低的利率债和长久期利率债，同时提高信用类债券占比，组合杠杆率维持在 120%以内。

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 1.0288 元，报告期内，份额净值增长率为 2.36%，同期业绩基准增长率为 1.08%；本基金 C 份额净值为 1.0220 元，报告期内，份额净值增长率为 2.20%，同期业绩基准增长率为 1.08%。

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 | 176,298,023.07 | 24.29 |
| | 其中：股票 | 176,298,023.07 | 24.29 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 523,831,241.43 | 72.18 |
| | 其中：债券 | 523,831,241.43 | 72.18 |
| | 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 | 3,998,231.23 | 0.55 |
| | 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 | 17,823,229.49 | 2.46 |
| 8 | 其他资产 | 3,778,821.29 | 0.52 |
| 9 | 合计 | 725,729,546.51 | 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 1,157,670.00 元，占基金资产净值比例 0.20%。

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 | 3,818,097.00 | 0.64 |
| C | 制造业 | 103,236,151.99 | 17.43 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,750,638.82 | 1.98 |
| E | 建筑业 | 3,847,329.12 | 0.65 |
| F | 批发和零售业 | 12,411,431.84 | 2.10 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 332,182.86 | 0.06 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 7,666,757.24 | 1.29 |
| J | 金融业 | 16,118,991.06 | 2.72 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 7,324,843.00 | 1.24 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 50,587.45 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 8,509,814.15 | 1.44 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 73,528.54 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 175,140,353.07 | 29.57 |

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 | - | - |
| 非必需消费 | - | - |
| 必需消费品 | - | - |
| 医疗保健 | 249,990.00 | 0.04 |
| 金融 | - | - |
| 科技 | - | - |
| 通讯 | - | - |
| 公用事业 | 907,680.00 | 0.15 |
| 房地产 | - | - |
| 政府 | - | - |
| 合计 | 1,157,670.00 | 0.20 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 4,400 | 8,008,000.00 | 1.35 |
| 2 | 600660 | 福耀玻璃 | 208,400 | 7,243,984.00 | 1.22 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 230,000 | 6,697,600.00 | 1.13 |
| 4 | 300750 | 宁德时代 | 15,500 | 6,293,775.00 | 1.06 |
| 5 | 601985 | 中国核电 | 933,118 | 5,962,624.02 | 1.01 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 110,087 | 5,923,781.47 | 1.00 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 350,000 | 5,911,500.00 | 1.00 |
| 8 | 601877 | 正泰电器 | 210,988 | 5,901,334.36 | 1.00 |
| 9 | 002027 | 分众传媒 | 768,900 | 5,282,343.00 | 0.89 |
| 10 | 000001 | 平安银行 | 400,202 | 5,014,531.06 | 0.85 |

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 | 65,272,071.23 | 11.02 |
| | 其中：政策性金融债 | 35,138,575.34 | 5.93 |
| 4 | 企业债券 | 305,959,455.96 | 51.66 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 132,266,822.18 | 22.33 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 20,332,892.06 | 3.43 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 523,831,241.43 | 88.45 |

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 | 102280919 | 22 浙江机场 MTN001A | 300,000 | 30,902,837.26 | 5.22 |
| 2 | 185573 | 22 国机 02 | 300,000 | 30,690,177.53 | 5.18 |
| 3 | 149843 | 22 广晟 01 | 300,000 | 30,193,241.10 | 5.10 |
| 4 | 185504 | 22 浙资 01 | 300,000 | 30,163,772.06 | 5.09 |
| 5 | 185512 | 22 东吴 03 | 300,000 | 30,133,495.89 | 5.09 |

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 | 86,073.73 |

| | | |
|---|---------|--------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 3,664,834.44 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 27,913.12 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,778,821.29 |

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 | 128048 | 张行转债 | 3,638,953.44 | 0.61 |
| 2 | 113052 | 兴业转债 | 3,383,172.74 | 0.57 |
| 3 | 123113 | 仙乐转债 | 2,092,908.63 | 0.35 |
| 4 | 113042 | 上银转债 | 1,910,742.43 | 0.32 |
| 5 | 127056 | 中特转债 | 1,459,908.90 | 0.25 |
| 6 | 110073 | 国投转债 | 1,394,741.70 | 0.24 |
| 7 | 113062 | 常银转债 | 1,202,651.21 | 0.20 |
| 8 | 113050 | 南银转债 | 1,059,563.95 | 0.18 |
| 9 | 110062 | 烽火转债 | 901,233.95 | 0.15 |
| 10 | 128035 | 大族转债 | 835,813.70 | 0.14 |
| 11 | 110081 | 闻泰转债 | 630,525.92 | 0.11 |
| 12 | 113024 | 核建转债 | 583,711.52 | 0.10 |
| 13 | 113043 | 财通转债 | 519,395.57 | 0.09 |
| 14 | 128136 | 立讯转债 | 323,120.50 | 0.05 |
| 15 | 113054 | 绿动转债 | 239,295.32 | 0.04 |
| 16 | 113602 | 景 20 转债 | 157,152.58 | 0.03 |

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 | 南方宝裕混合 A | 南方宝裕混合 C |
|---------------------------|------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,116,983,508.73 | 23,038,994.95 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 5,317,427.81 | 1,096,687.34 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 560,208,012.20 | 10,479,141.20 |
| 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 | 562,092,924.34 | 13,656,541.09 |
|-------------|----------------|---------------|

§ 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、《南方宝裕混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方宝裕混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、南方宝裕混合型证券投资基金 2023 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>