

# 南方誉盈一年持有期混合型证券投资 基金 2024 年第 3 季度报告

2024 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2024 年 10 月 25 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 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 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                       |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 南方誉盈一年持有混合                                                                                                                                            |
| 基金主代码      | 014094                                                                                                                                                |
| 交易代码       | 014094                                                                                                                                                |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                |
| 基金合同生效日    | 2021 年 12 月 2 日                                                                                                                                       |
| 报告期末基金份额总额 | 290,470,956.40 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，力求将信用风险降到最低，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×10%+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×85%                                                                                                   |
| 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           | 上海浦东发展银行股份有限公司   |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 南方誉盈一年持有混合 A     | 南方誉盈一年持有混合 C    |
| 下属分级基金的交易代码     | 014094           | 014095          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 277,756,577.28 份 | 12,714,379.12 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（2024 年 7 月 1 日—2024 年 9 月 30 日） |               |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
|                 | 南方誉盈一年持有混合 A                        | 南方誉盈一年持有混合 C  |
| 1. 本期已实现收益      | 2,354,749.61                        | 90,045.23     |
| 2. 本期利润         | 9,344,827.57                        | 370,709.05    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0314                              | 0.0260        |
| 4. 期末基金资产净值     | 305,093,977.71                      | 13,730,741.41 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0984                              | 1.0799        |

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

南方誉盈一年持有混合 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      | 3.35%    | 0.47%       | 3.02%      | 0.19%         | 0.33%  | 0.28% |
| 过去六个月      | 4.97%    | 0.38%       | 4.75%      | 0.16%         | 0.22%  | 0.22% |
| 过去一年       | 3.56%    | 0.37%       | 6.88%      | 0.16%         | -3.32% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.84%    | 0.33%       | 9.84%      | 0.17%         | 0.00%  | 0.16% |

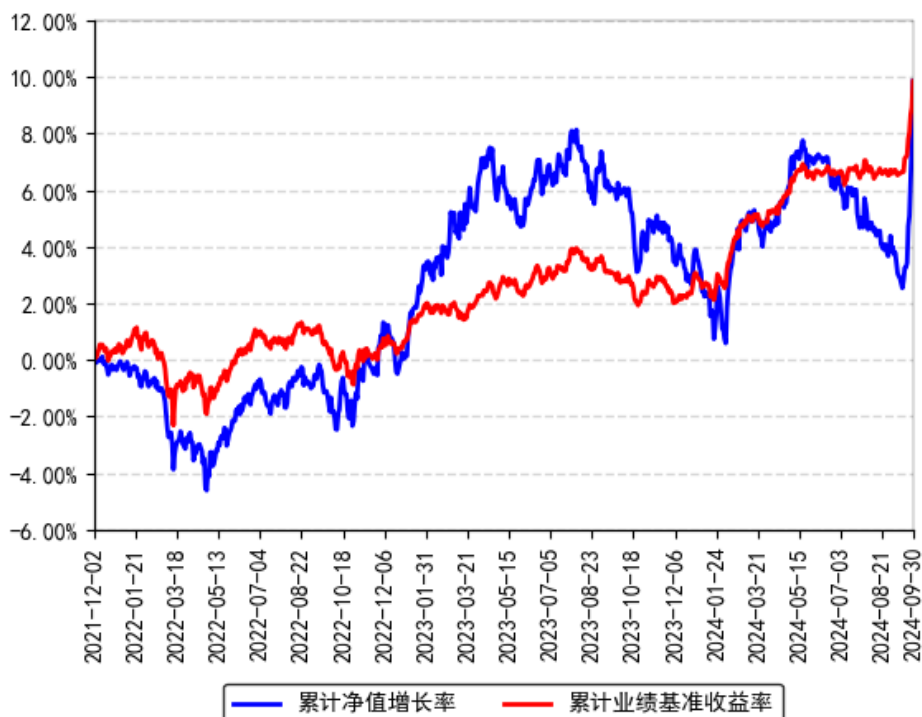
南方誉盈一年持有混合 C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|------------|------------|--------------|-----|-----|
|----|----------|------------|------------|--------------|-----|-----|

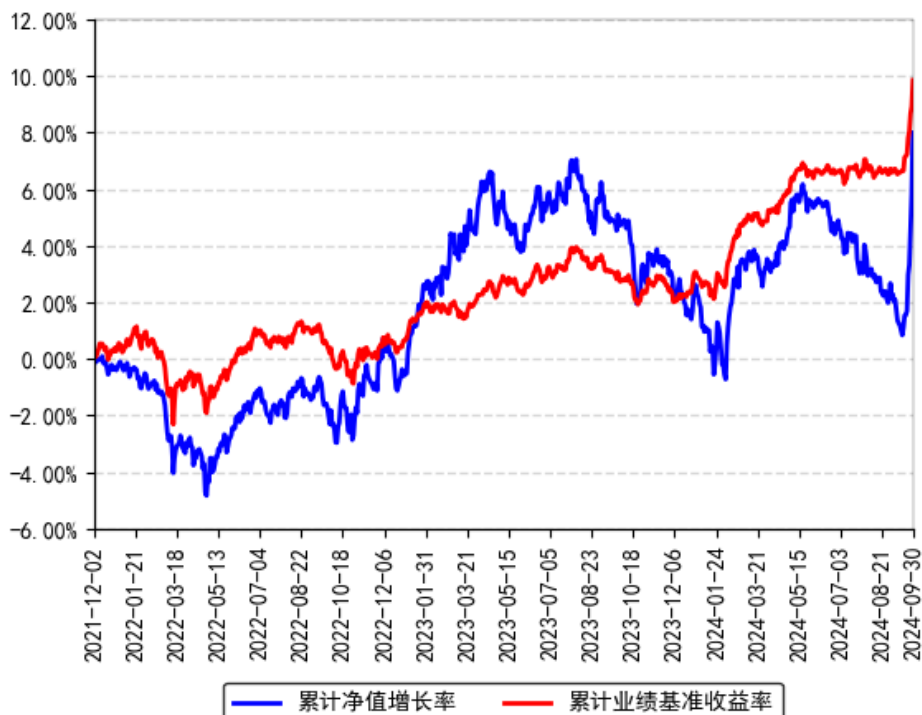
|            |       | ②     |       | 准差④   |        |       |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去三个月      | 3.19% | 0.47% | 3.02% | 0.19% | 0.17%  | 0.28% |
| 过去六个月      | 4.65% | 0.38% | 4.75% | 0.16% | -0.10% | 0.22% |
| 过去一年       | 2.94% | 0.37% | 6.88% | 0.16% | -3.94% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.99% | 0.33% | 9.84% | 0.17% | -1.85% | 0.16% |

### 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

南方誉盈一年持有混合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



南方誉盈一年持有混合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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 刘树坤 | 本基金基金经理 | 2021年12月2日  | -    | 20年    | 中国农业大学农业经济管理专业硕士，具有基金从业资格。曾任联合证券研究所首席分析师；2008年11月加入南方基金，曾任权益研究部资深研究员，负责食品饮料行业研究；2011年6月20日至2015年2月11日，任投资经理助理；2015年2月11日至2021年2月5日，任投资经理；2021年2月5日至2023年3月15日，任南方瑞利混合基金经理；2021年2月5日至今，兼任投资经理；2021年12月2日至今，任南方誉盈一年持有混合基金经理；2022年5月6日至今，任南方誉稳一年持有混合基金经理。 |
| 刘益成 | 本基金基金经  | 2022年3月2日   | -    | 16年    | 北京大学计算机应用专业硕士，具有基金从业资格。曾担任招商银行金融市场                                                                                                                                                                                                                     |

|  |   |  |  |  |                                                                                                                                                  |
|--|---|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 理 |  |  |  | 部债券交易员、投资账户经理助理、投资经理。2014 年 1 月加入南方基金；2014 年 6 月 10 日至 2022 年 3 月 2 日，任投资经理；2022 年 3 月 2 日至今，任南方誉盈一年持有混合基金经理；2022 年 12 月 23 日至今，任南方誉稳一年持有混合基金经理。 |
|--|---|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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             |
|-----|----------|---------|--------------------|------------------|
| 刘树坤 | 公募基金     | 2       | 708,010,305.20     | 2021 年 02 月 05 日 |
|     | 私募资产管理计划 | 6       | 2,879,386,625.04   | 2015 年 04 月 07 日 |
|     | 其他组合     | 91      | 142,935,119,520.92 | 2015 年 03 月 02 日 |
|     | 合计       | 99      | 146,522,516,451.16 | -                |

注：报告期内，基金经理（刘树坤）不再担任 2 个其他组合的投资经理职务，离任日期分别为 2024 年 07 月 04 日、2024 年 09 月 30 日。

## 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 11 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

三季度股票市场出现由极度悲观到亢奋的 V 型大逆转。期间大多时候，股票市场连续下跌，而债券市场屡创新高，将投资者极度悲观的情绪演绎得淋漓尽致，股市日交易量更是跌破 5000 亿的阶段性低点。直至 9.24 日国务院新闻发布会之后才风云突变，股市实现历史级大反弹，诸多指数单周反弹幅度突破纪录，交易量更是创下 2.61 万亿的天量纪录。形势的逆转，不论是从反弹的幅度、节奏、及市场的亢奋程度，相信在中国股票历史市场上，将是一个里程碑。

9.24 国新会的多项重磅政策，包括降准降息，房地产支持，及大力度支持资本市场的政策，创新央行互换便利、回购资金支持等工具。随后政治局会议被认为是打破惯例聚焦经济，超预期确立了此轮政策大转向的基调，政策稳经济、稳市场、稳信心决心和力度空前，会议首次提到促进房地产市场“止跌企稳”，极大地扭转了前期关于资产负债表收缩、通缩的悲观论调。叠加资产价格处于极端压缩、市场信心极度低迷的底部，股市迅速从极度悲观迅速转向亢奋，既在意料之外，也在情理之中。

在此轮股市反转中，接近策略上限的高权益仓位配置，让本组合获得理想的投资收益。前期市场的持续下跌中，我们保持逆向布局，较高的权益仓位和偏稳健的结构，使得在控制好回撤的基础上，能够较好分享到大涨的机会。期间权益配置保持相对稳定，在均衡行业分布、和低估值的配置的基础上，持续优化持仓结构，小幅增加消费、能源等领域的配置，略降低红利、医药板块的比例。固收方面，随着市场信心的恢复，债券收益率在 9 月出现大幅调整后具备较好投资价值，组合买入高等级信用债，提高组合仓位至 130%、久期至 2.0。

投资过程中不可避免需要面临不同的风险，一种是投资失误遭受损失的风险；另一种是错过机会没能获得合理回报的风险，也就是说，亏钱或者错过机会本身都意味风险。

过去近 3 年以来的股票熊市，让更多投资者更多考虑的是损失的风险和追求确定性收益，将低风险资产的收益率压低到一个极致的水平。而当风险被赋予过高的权重，意味着机会被忽视和低估，意味着未来可能会有更多回报丰厚的机会留在前方。

季度末的重要会议标志着政策向稳增长、稳信心的大转变，很大程度上，前期关于失落若干年的悲观逻辑已经得到根本性的扭转，接下来投资者需要面临的是如何更好把握可能的机会。当然，市场的发展不可能一帆风顺，不同阶段可能面临不同的形势，可能演变。第一阶段是估值修复，在政策出来后迅速走出过度悲观预期，整体风险偏好上升，市场估值快速提升甚至可能过热；第二阶段是积极政策的期待和陆续落地，市场整体向好但分歧开始加大，

波动和结构分化加剧。第三阶段是等待宏观基本面验证，并对中长期形势形成新的预期或担忧。第一阶段的发展可能最为迅速，二阶段需要更多的跟踪和耐心，而第三阶段的基本面是未来行情空间和长度的主要决定因素。

周期上看，当前市场可能仍处于转折早期的第一阶段，或者在第一阶段向第二阶段过渡，后续随着积极政策的落地和见效，大的宏观环境，包括经济数据、地产、消费、物价，以及资产市场方面可能都将以积极因素为主。估值方面，底部反弹之后，很多的股票资产长周期看仍处于低估状态。

本基金在做好风险防范的基础上，将持续优化组合的资产配置，保持偏高的权益仓位，以及中性偏高的债券仓位。后续将跟随经济形势的转变，寻找可能在新周期中积极转变的机会：一是受益于经济回暖盈利改善明显的消费、制造和周期等领域；二是符合中长期高质量发展的科技、新能源、数字经济、医药生物等领域；三是供给格局改善，具有核心竞争力的制造和资源品种；四是仍处于被低估的稳健资产，如能源、运营商、央企等。债券方面，在当前经济基本面和宽松货币政策取向下，债券收益率有所超调，组合将维持高仓位和偏高的久期。

#### 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 1.0984 元，报告期内，份额净值增长率为 3.35%，同期业绩基准增长率为 3.02%；本基金 C 份额净值为 1.0799 元，报告期内，份额净值增长率为 3.19%，同期业绩基准增长率为 3.02%。

#### 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   | 93,289,562.11  | 22.32        |
|    | 其中：股票  | 93,289,562.11  | 22.32        |
| 2  | 基金投资   | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 303,072,143.16 | 72.52        |
|    | 其中：债券  | 303,072,143.16 | 72.52        |
|    | 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          | 7,600,000.00   | 1.82   |
|   | 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      | 11,146,036.22  | 2.67   |
| 8 | 其他资产              | 2,804,879.80   | 0.67   |
| 9 | 合计                | 417,912,621.29 | 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 19,232,147.08 元，占基金资产净值比例 6.03%。

## 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              | 4,318,871.00  | 1.35         |
| C  | 制造业              | 47,464,434.27 | 14.89        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,761,294.00  | 1.49         |
| E  | 建筑业              | 5,888,716.00  | 1.85         |
| 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           | 2,511,788.76  | 0.79         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 7,784,379.00  | 2.44         |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 753,498.00    | 0.24         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 574,434.00    | 0.18         |
| 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               | 74,057,415.03 | 23.23        |

### 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   | 3,398,247.72 | 1.07         |

|        |               |      |
|--------|---------------|------|
| 工业     | 1,189,677.44  | 0.37 |
| 非必需消费品 | -             | -    |
| 必需消费品  | -             | -    |
| 医疗保健   | -             | -    |
| 金融     | -             | -    |
| 科技     | 6,357,335.44  | 1.99 |
| 通讯     | 8,286,886.48  | 2.60 |
| 公用事业   | -             | -    |
| 房地产    | -             | -    |
| 政府     | -             | -    |
| 合计     | 19,232,147.08 | 6.03 |

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

金额单位：人民币元

| 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  | 00941  | 中国移动 | 55,500  | 3,676,124.39 | 1.15         |
| 2  | 600941 | 中国移动 | 15,900  | 1,744,230.00 | 0.55         |
| 3  | 01171  | 兖矿能源 | 343,200 | 3,398,247.72 | 1.07         |
| 4  | 600188 | 兖矿能源 | 82,290  | 1,374,243.00 | 0.43         |
| 5  | 00700  | 腾讯控股 | 11,500  | 4,610,762.09 | 1.45         |
| 6  | 002439 | 启明星辰 | 266,000 | 4,572,540.00 | 1.43         |
| 7  | 605090 | 九丰能源 | 148,300 | 4,260,659.00 | 1.34         |
| 8  | 300750 | 宁德时代 | 16,740  | 4,216,638.60 | 1.32         |
| 9  | 00981  | 中芯国际 | 204,500 | 3,845,074.75 | 1.21         |
| 10 | 600690 | 海尔智家 | 112,300 | 3,610,445.00 | 1.13         |
| 11 | 601668 | 中国建筑 | 565,000 | 3,491,700.00 | 1.10         |
| 12 | 002236 | 大华股份 | 188,800 | 3,251,136.00 | 1.02         |

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      | 16,241,135.34  | 5.09         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 160,320,930.23 | 50.28        |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | 114,572,149.04 | 35.94        |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -     |
| 6  | 中期票据      | -              | -     |
| 7  | 可转债（可交换债） | 11,937,928.55  | 3.74  |
| 8  | 同业存单      | -              | -     |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 303,072,143.16 | 95.06 |

### 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  | 2028053   | 20 中国银行永续债 03 | 200,000 | 21,321,956.28 | 6.69         |
| 2  | 2128044   | 21 工商银行永续债 02 | 200,000 | 21,164,644.81 | 6.64         |
| 3  | 240173    | G23 京 Y1      | 200,000 | 20,743,079.45 | 6.51         |
| 4  | 242380013 | 23 建行永续债 01   | 200,000 | 20,742,164.38 | 6.51         |
| 5  | 240119    | 23 华电 K1      | 200,000 | 20,660,263.01 | 6.48         |

### 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚；中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

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   | 14,845.14    |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,788,429.90 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 1,604.76     |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,804,879.80 |

## 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  | 113067 | 燃 23 转债  | 1,624,961.23 | 0.51         |
| 2  | 127054 | 双箭转债     | 1,243,147.84 | 0.39         |
| 3  | 127020 | 中金转债     | 1,152,805.50 | 0.36         |
| 4  | 127050 | 麒麟转债     | 1,134,671.23 | 0.36         |
| 5  | 113062 | 常银转债     | 1,062,850.93 | 0.33         |
| 6  | 113021 | 中信转债     | 848,820.23   | 0.27         |
| 7  | 123150 | 九强转债     | 701,185.09   | 0.22         |
| 8  | 113631 | 皖天转债     | 642,500.14   | 0.20         |
| 9  | 127032 | 苏行转债     | 626,327.40   | 0.20         |
| 10 | 128081 | 海亮转债     | 527,043.32   | 0.17         |
| 11 | 132026 | G 三峡 EB2 | 516,746.96   | 0.16         |
| 12 | 127056 | 中特转债     | 515,754.29   | 0.16         |
| 13 | 113669 | 景 23 转债  | 388,551.78   | 0.12         |
| 14 | 113682 | 益丰转债     | 309,508.47   | 0.10         |
| 15 | 110094 | 众和转债     | 279,642.80   | 0.09         |
| 16 | 113055 | 成银转债     | 253,963.06   | 0.08         |
| 17 | 110079 | 杭银转债     | 109,448.28   | 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           | 南方誉盈一年持有混合 A   | 南方誉盈一年持有混合 C  |
|--------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额  | 328,531,994.99 | 16,326,849.85 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 300,638.23     | 23,466.27     |

|                           |                |               |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 51,076,055.94  | 3,635,937.00  |
| 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               | 277,756,577.28 | 12,714,379.12 |

## § 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

| 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              | 20240701-20240930        | 86,097,372.52 | -    | 7,225,800.53 | 78,871,571.99 | 27.15% |

#### 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、《南方誉盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方誉盈一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、南方誉盈一年持有期混合型证券投资基金 2024 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>