

南方宁悦一年持有期混合型证券投资 基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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：宁波银行股份有限公司

送出日期：2021 年 10 月 27 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 南方宁悦一年持有期混合 |
| 基金主代码 | 010742 |
| 交易代码 | 010742 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 1 月 6 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,464,584,570.71 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 | 宁波银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 南方宁悦一年持有期混合 A | 南方宁悦一年持有期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 010742 | 010743 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 5,080,781,749.87 份 | 383,802,820.84 份 |

注：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“南方宁悦一年持有期混合”。

§ 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（2021 年 7 月 1 日—2021 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|----------------|
| | 南方宁悦一年持有期混合 A | 南方宁悦一年持有期混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 90,212,356.03 | 6,396,005.32 |
| 2. 本期利润 | 73,523,984.85 | 5,137,468.84 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0145 | 0.0134 |
| 4. 期末基金资产净值 | 5,235,963,787.15 | 394,369,952.72 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0305 | 1.0275 |

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

南方宁悦一年持有期混合 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 | 1.43% | 0.23% | -0.40% | 0.18% | 1.83% | 0.05% |
| 过去六个月 | 2.54% | 0.18% | 0.50% | 0.15% | 2.04% | 0.03% |
| 自基金合同 | 3.05% | 0.16% | 0.22% | 0.18% | 2.83% | -0.02% |

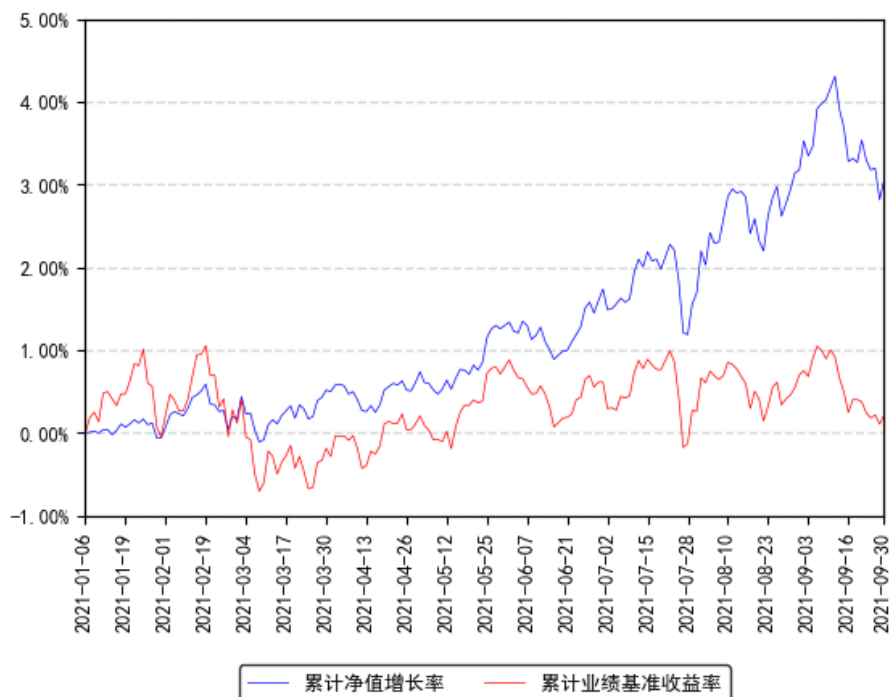
| | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|

南方宁悦一年持有期混合 C

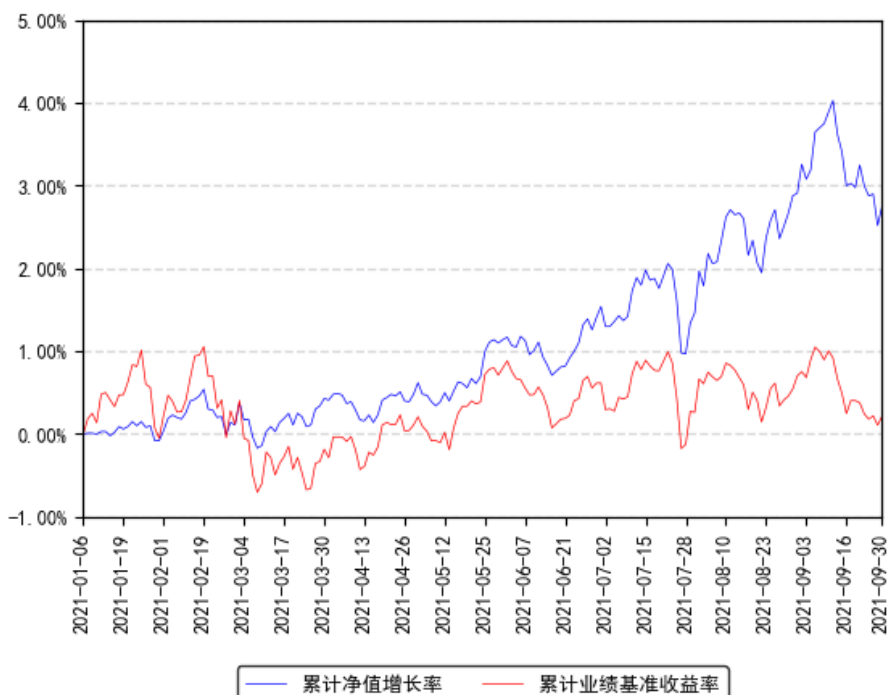
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 1.32% | 0.23% | -0.40% | 0.18% | 1.72% | 0.05% |
| 过去六个月 | 2.33% | 0.18% | 0.50% | 0.15% | 1.83% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.75% | 0.16% | 0.22% | 0.18% | 2.53% | -0.02% |

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

南方宁悦一年持有期混合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



南方宁悦一年持有期混合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：本基金合同于 2021 年 1 月 6 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，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 | 2021 年 1 月 6 日 | - | 18 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；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基金经理；2015 年 5 月 29 日至 2018 年 6 月 5 日，任南方丰合保本基金基金经理；2016 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>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。</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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券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 | 6 | 27,608,450,501.59 | 2010 年 12 月 14 日 |

| | | | |
|----------|----|-------------------|------------------|
| 私募资产管理计划 | 1 | 10,460,930.50 | 2020 年 9 月 11 日 |
| 其他组合 | 14 | 65,247,753,429.01 | 2007 年 12 月 27 日 |
| 合计 | 21 | 92,866,664,861.10 | - |

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，未出现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% 的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度经济基本面走弱趋势越来越明显，虽然 PPI 继续维持高位，但预计难以持续；PMI 更是连续走低，9 月份已降到 49.6，低于枯荣线。同时地产调控持续加强，贷款利率上行，地产销售和新开工面积已有回落，预计回落趋势仍将延续。海外复工叠加补贴削减，出口也在逐步走弱。这些迹象表明，疫情以来的经济复苏趋势并不牢固，接下来稳增长压力开始加大。流动性方面，考虑到经济复苏的不均衡，基础不牢固，监管层前瞻性地保持流动性充裕合理，十年国债收益率报告期内持续低位震荡。国内新冠疫情基本上得到控制，但部分地方零散有所反复，对国内经济活动和居民生活仍造成一定扰动。随着疫苗、特效药等不断发挥作用，新冠疫情预期将很快被彻底控制，对资本市场的影响也逐步消退。

A 股整体上维持震荡走势，结构上分化不断加大。顺周期及受益政策支持的相关板块表现较为优异。受煤炭价格大幅上涨，A 股煤炭标的涨幅较大，三季度采掘指数涨幅达到 36.6%；同时，电力短缺及部分地区拉闸限电，电力公司表现也比较突出，公用事业指数涨幅达 25.20%。此外，茅指数不断调整，消化前期上涨累积的高估值，食品饮料、医药生物、家电等表现靠后。固收方面，7 月份受益于国常会要求进一步加强金融对实体经济特别是中小微企业的支持以及央行全面降准，债券收益率快速下行，市场走出牛市行情。此后利率在经济基本面走弱与高企的 PPI 之间达到一种平衡，债市不断震荡。季末 9 月 PPI 进一步走高，整体资金面明显紧张，叠加美联储宽松政策可能于近期转向及率等原因，市场对央行进一步释放宽松政策的预期有所弱化，债券市场整体走弱。三季度整体来看，3 年 AAA 评级信用债收益率下行 22bp，3、5、10 年期国债收益率分别下行 27bp、24bp 和 20bp。

本基金权益仓位由 14%提升至 20%的中枢水平，在方向配置上我们坚持一贯思路，大体保持不变，主要集中在化工、银行、食品饮料、电气设备、汽车等业绩增长稳定或低估值相关的行业。固收方面，本基金抓住季初牛市机会，大量买入利率债维持住较高的债券仓位，同时买入 3 年期信用债和 10 年期利率债，保证组合久期和杠杆率水平符合债券牛市行情；8-9 月主要以买入短融和少量 3 年期信用债为主，同时对长久期利率债进行波段操作。

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 1.0305 元，报告期内，份额净值增长率为 1.43%，同期业绩基准增长率为-0.40%；本基金 C 份额净值为 1.0275 元，报告期内，份额净值增长率为 1.32%，同期业绩基准增长率为-0.40%。

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 | 1,142,092,286.64 | 16.23 |
| | 其中：股票 | 1,142,092,286.64 | 16.23 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 5,769,844,906.65 | 82.01 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 其中：债券 | 5,769,844,906.65 | 82.01 |
| | 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 | 35,347,715.66 | 0.50 |
| 8 | 其他资产 | 88,276,003.91 | 1.25 |
| 9 | 合计 | 7,035,560,912.86 | 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 47,111,425.71 元，占基金资产净值比例 0.84%；通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 105,477,795.26 元，占基金资产净值比例 1.87%。

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 | 38,760,497.08 | 0.69 |
| C | 制造业 | 594,994,401.14 | 10.57 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 31,207,262.04 | 0.55 |
| E | 建筑业 | 20,183.39 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 4,246,667.78 | 0.08 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,968,000.00 | 0.03 |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,345.12 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 27,886,025.69 | 0.50 |
| J | 金融业 | 181,069,004.79 | 3.22 |
| K | 房地产业 | 23,333,244.00 | 0.41 |
| L | 租赁和商务服务业 | 33,149,246.56 | 0.59 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 15,224.88 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 32,100,625.33 | 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 | 20,749,337.87 | 0.37 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 989,503,065.67 | 17.57 |

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 | 2,899,048.80 | 0.05 |
| 材料 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 非必需消费 | - | - |
| 必需消费品 | 3,760,432.84 | 0.07 |
| 医疗保健 | 802,356.74 | 0.01 |
| 金融 | 2,405,494.07 | 0.04 |
| 科技 | 33,179,513.55 | 0.59 |
| 通讯 | 29,685,859.84 | 0.53 |
| 公用事业 | 70,752,502.23 | 1.26 |
| 房地产 | 9,104,012.90 | 0.16 |
| 政府 | - | - |
| 合计 | 152,589,220.97 | 2.71 |

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 | 601166 | 兴业银行 | 3,103,672 | 56,797,197.60 | 1.01 |
| 2 | 01816 | 中广核电力 | 26,098,000 | 51,526,643.71 | 0.92 |
| 3 | 601009 | 南京银行 | 5,595,500 | 50,639,275.00 | 0.90 |
| 4 | 000001 | 平安银行 | 2,414,583 | 43,293,473.19 | 0.77 |
| 5 | 600176 | 中国巨石 | 2,304,250 | 40,508,715.00 | 0.72 |
| 6 | 600887 | 伊利股份 | 1,050,300 | 39,596,310.00 | 0.70 |
| 7 | 601877 | 正泰电器 | 621,247 | 35,162,580.20 | 0.62 |
| 8 | 00763 | 中兴通讯 | 1,555,800 | 33,179,513.55 | 0.59 |
| 9 | 600741 | 华域汽车 | 1,412,583 | 32,235,144.06 | 0.57 |
| 10 | 600323 | 瀚蓝环境 | 1,207,866 | 32,008,449.00 | 0.57 |

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 | 1,320,368,000.00 | 23.45 |

| | | | |
|----|-----------|------------------|--------|
| | 其中：政策性金融债 | 615,117,000.00 | 10.93 |
| 4 | 企业债券 | 1,677,834,903.20 | 29.80 |
| 5 | 企业短期融资券 | 758,108,500.00 | 13.46 |
| 6 | 中期票据 | 840,070,900.00 | 14.92 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 150,237,603.45 | 2.67 |
| 8 | 同业存单 | 1,023,225,000.00 | 18.17 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 5,769,844,906.65 | 102.48 |

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 | 210210 | 21 国开 10 | 2,900,000 | 294,611,000.00 | 5.23 |
| 2 | 112103014 | 21 农业银行 CD014 | 2,000,000 | 195,680,000.00 | 3.48 |
| 3 | 112104009 | 21 中国银行 CD009 | 2,000,000 | 195,680,000.00 | 3.48 |
| 4 | 112110097 | 21 兴业银行 CD097 | 2,000,000 | 194,300,000.00 | 3.45 |
| 5 | 012100552 | 21 江西交投 SCP001 | 1,400,000 | 140,476,000.00 | 2.49 |

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除 19 国开 02（证券代码 190202）、21 国开 10（证券代码 210210）、21 农业银行 CD014（证券代码 112103014）、21 兴业银行 CD097（证券代码 112110097）、21 中国银行 CD009（证券代码 112104009）、21 中国银行 CD012（证券代码 112104012）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、19 国开 02（证券代码 190202）

根据中国银保监会公告，2020 年 12 月 25 日，因国家开发银行存在“为违规的政府购买服务项目提供融资”等 24 项违规情形，中国银保监会决定对其处罚款 4880 万元。

2、21 国开 10（证券代码 210210）

根据中国银保监会公告，2020 年 12 月 25 日，因国家开发银行存在“为违规的政府购买服务项目提供融资”等 24 项违规情形，中国银保监会决定对其处罚款 4880 万元。

3、21 农业银行 CD014（证券代码 112103014）

处罚时间：2020 年 7 月 13 日 处罚依据：（一）向关系人发放信用贷款（二）批量处置不良资产未公告（三）批量处置不良资产未向监管部门报告等 处罚结果：罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元

4、21 兴业银行 CD097（证券代码 112110097）

兴业银行 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罚款 5 万元。

5、21 中国银行 CD009（证券代码 112104009）

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

6、21 中国银行 CD012（证券代码 112104012）

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

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 | 375,018.10 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,478,660.89 |
| 3 | 应收股利 | 408,332.79 |
| 4 | 应收利息 | 84,013,992.13 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 88,276,003.91 |

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 | 132004 | 15 国盛 EB | 51,342,025.00 | 0.91 |
| 2 | 132015 | 18 中油 EB | 49,411,626.40 | 0.88 |
| 3 | 132009 | 17 中油 EB | 25,281,600.00 | 0.45 |

| | | | | |
|---|--------|------|--------------|------|
| 4 | 113026 | 核能转债 | 5,893,650.00 | 0.10 |
| 5 | 110073 | 国投转债 | 5,804,272.50 | 0.10 |
| 6 | 110077 | 洪城转债 | 5,782,434.10 | 0.10 |
| 7 | 113024 | 核建转债 | 3,677,638.20 | 0.07 |
| 8 | 128083 | 新北转债 | 2,092,200.00 | 0.04 |
| 9 | 128141 | 旺能转债 | 952,157.25 | 0.02 |

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 | 南方宁悦一年持有期混合 A | 南方宁悦一年持有期混合 C |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 5,064,697,843.71 | 381,898,951.08 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 16,083,906.16 | 1,903,869.76 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - | - |
| 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 | 5,080,781,749.87 | 383,802,820.84 |

§ 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、《南方宁悦一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方宁悦一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、南方宁悦一年持有期混合型证券投资基金 2021 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>