

南方安泰混合型证券投资基金 2021 年 第 4 季度报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 1 月 24 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 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 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南方安泰混合
基金主代码	003161
交易代码	003161
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 22 日
报告期末基金份额总额	9,488,255,985.94 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，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值，为投资者提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金在资产配置方面采用优化的恒定比例投资组合保险策略（优化 CPPI）。CPPI 策略是国际通行的一种投资组合保险策略，优化的 CPPI 策略是对 CPPI 策略的一种优化，它主要是通过金融工程技术和数量分析等工具，根据市场的波动来动态调整风险资产与稳健资产在投资组合中的比重，以确保投资组合在一段时间以后的价值不低于事先设定的某一目标价值，以达到增强组合收益的效果。该策略的具体实施主要有以下步骤：第一步，确定基金价值底线。根据投资组合期末最低目标价值和合理的折现率设定当前应持有的稳健资产的数量，即投资组合的价值底线，计算投资组合现时净值超过价值底线的数额；第二步，确定风险资产。将相当于净值超过价值底线的数额特定倍数的资金投资于风险资产（如股票

	等), 以实现最低目标价值的增值。第三步, 调整风险乘数及资产配置比例。本基金将根据市场波动的特点以及预期的风险与收益的匹配关系, 定期计算风险乘数上限并对实际风险乘数进行监控, 一旦实际风险乘数超过当期风险乘数上限, 则重复前两个步骤的操作, 对风险乘数进而整体资产配置比例进行动态调整。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15%+上证国债指数收益率×85%	
风险收益特征	本基金为债券投资为主的混合型基金, 属于中低风险、中低收益预期的基金品种, 其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金, 低于股票型基金。本基金为债券投资为主的混合型基金, 属于中低风险、中低收益预期的基金品种, 其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金, 低于股票型基金。前款有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述, 代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价, 不同销售机构采用的评价方法也不同, 因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同。本基金的风险等级可能有相应变化, 具体风险评级结果应以销售机构的评级结果为准。	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方安泰混合 A	南方安泰混合 C
下属分级基金的交易代码	003161	012220
报告期末下属分级基金的份额总额	9,343,494,453.11 份	144,761,532.83 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“南方安泰混合”。

§ 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 10 月 1 日—2021 年 12 月 31 日)	
	南方安泰混合 A	南方安泰混合 C
1. 本期已实现收益	59,810,636.66	512,241.99
2. 本期利润	193,334,831.38	1,982,701.32
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0200	0.0189
4. 期末基金资产净值	10,606,969,398.15	164,057,809.76
5. 期末基金份额净值	1.1352	1.1333

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

南方安泰混合 A

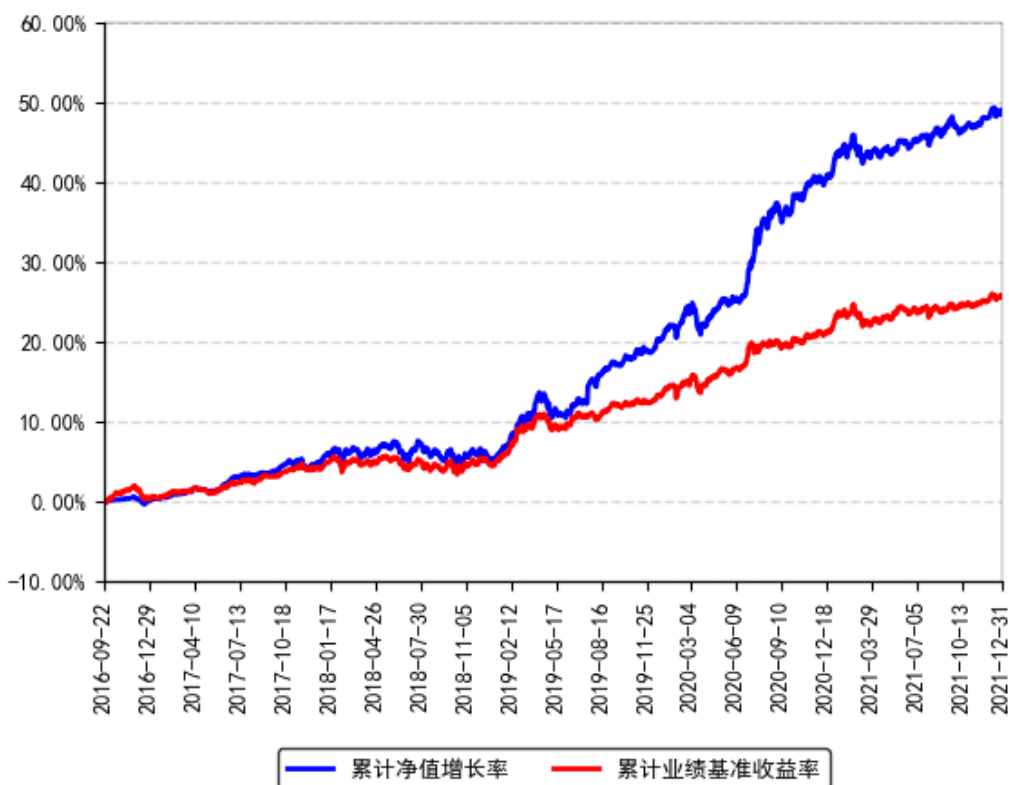
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.78%	0.16%	1.13%	0.13%	0.65%	0.03%
过去六个月	2.52%	0.18%	1.37%	0.16%	1.15%	0.02%
过去一年	5.00%	0.22%	2.98%	0.18%	2.02%	0.04%
过去三年	41.51%	0.28%	20.23%	0.19%	21.28%	0.09%
过去五年	48.83%	0.25%	25.31%	0.18%	23.52%	0.07%
自基金合同生效起至今	48.97%	0.24%	25.77%	0.18%	23.20%	0.06%

南方安泰混合 C

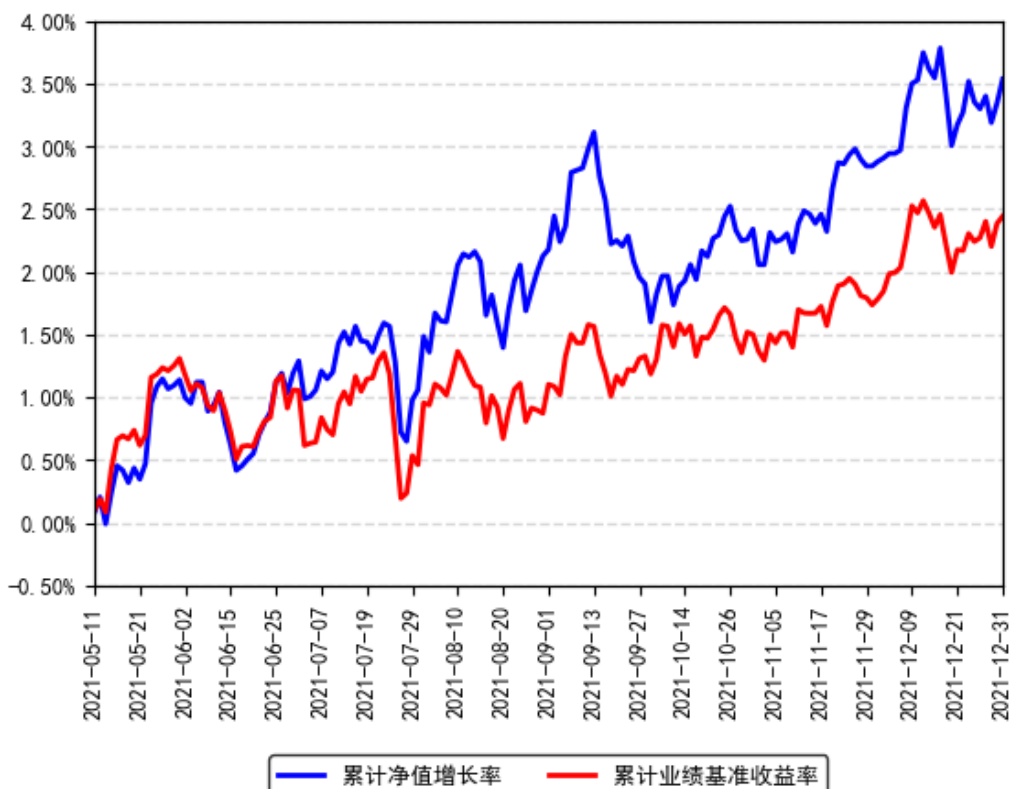
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.69%	0.15%	1.13%	0.13%	0.56%	0.02%
过去六个月	2.32%	0.18%	1.37%	0.16%	0.95%	0.02%
自基金合同生效起至今	3.54%	0.17%	2.44%	0.16%	1.10%	0.01%

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

南方安泰混合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



南方安泰混合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：1、本基金从2021年5月10日起新增C类份额，C类份额自2021年5月11日起存续。

§ 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	2016 年 9 月 22 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 年 1 月 11 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方益和保本基金基金经理；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，任南方甄智混合基金经理；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，任南方甄智混合基金经理；

					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。
杨旭	本基金基金经理	2020 年 9 月 25 日	-	12 年	伦敦政治经济学院硕士，具有基金从业资格。曾就职于中国银行股份有限公司总行、华夏基金管理有限公司，历任中国银行总行金融市场总部投资经理、司库投资经理，华夏基金机构债券投资部养老金、年金、专户投资经理。2019 年 12 月加入南方基金，2020 年 2 月 19 日至 2020 年 9 月 25 日，任投资经理；2020 年 9 月 25 日至今，任南方安泰混合基金经理。

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	30,136,412,012.76	2010 年 12 月 14 日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	14	68,568,083,611.37	2007 年 12 月 27 日
	合计	20	98,704,495,624.13	-

注：报告期内，孙鲁闽不再担任 1 个私募资产管理计划的投资经理职务，离任日期为 2021 年 10 月 19 日

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

经济基本面走弱趋势越来越明显，12 月份的中央经济工作会议明确表示“我国经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力”。持续高涨的 PPI 终于出现拐点，预计后续下行将对工业企业盈利造成负面影响；虽然稳增长政策的推进，PMI 四季度有所反弹，但仍在枯荣线附近震荡，短期经济景气不容乐观。地产严控后果显现，新冠疫情不断反复，中美贸易摩擦不时升级，这些因素均对经济持续增长造成较大干扰，疫情以来的经济复苏趋势并不牢固，接下来稳增长压力会不断增加。政策方面，目前处于宽货币紧信用状态，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震荡下行；与此同时，年初以来社融增速持续走低，四季度处于底部震荡。

A 股整体上维持震荡走势，结构上维持分化，风格不断切换，整体上看宽货币紧信用的格局下小市值成长风格表现较好。元宇宙主题相关的传媒、通信、计算机等板块和个股表现比较优秀，以申万传媒指数为例，四季度涨幅超过 20%，某种程度上这预示着市场在经济下行环境下对未来成长板块的追逐，但我们应警惕短期炒作的成份。受益于 PPI 向 CPI 传导的预期，许多消费品开始涨价，市场预期相关企业盈利会有一定改善，从而食品饮料本季度也有很好的表现。随着猪价震荡回落，产能去库存加剧，市场开始期待猪周期带来

的投资机会，农林牧渔指数本季度涨幅也比较靠前。此外，前期上涨较多的钢铁、煤炭等上游板块本季度表现靠后。

固收方面，四季度随着投资、消费全面下行，稳增长压力凸显，再加上部分领域风险隐现，市场流动性持续宽松，债券收益率快速下行。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。

报告期内本基金权益仓位大致维持不变，基本保持 20%的中枢水平附近，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，本基金维持债券高仓位，以买入 3 年内高资质信用债和 10 年国开债为主，其中长久期国开债 10 月减持后 11 月增持，波段操作贡献正收益；转债部分以买入低溢价率的银行、建筑、公用事业转债为主。

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 1.1352 元，报告期内，份额净值增长率为 1.78%，同期业绩基准增长率为 1.13%；本基金 C 份额净值为 1.1333 元，报告期内，份额净值增长率为 1.69%，同期业绩基准增长率为 1.13%。

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	2,254,188,624.71	18.46
	其中：股票	2,254,188,624.71	18.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,397,885,791.44	76.98
	其中：债券	9,397,885,791.44	76.98
	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	138,000,260.00	1.13
	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	101,758,155.46	0.83

8	其他资产	317,091,093.83	2.60
9	合计	12,208,923,925.44	100.00

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	2,228,474.00	0.02
B	采矿业	100,743,128.30	0.94
C	制造业	1,477,385,083.71	13.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,100,917.01	0.53
E	建筑业	5,224,713.80	0.05
F	批发和零售业	25,883,329.66	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	77,510,258.30	0.72
J	金融业	321,905,145.32	2.99
K	房地产业	22,016,904.49	0.20
L	租赁和商务服务业	72,158,301.54	0.67
M	科学研究和技术服务业	18,969.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	53,485,133.07	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	38,505,496.73	0.36
S	综合	-	-
	合计	2,254,188,624.71	20.93

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	6,666,800	126,935,872.00	1.18
2	600741	华域汽车	3,365,500	95,243,650.00	0.88
3	600519	贵州茅台	46,000	94,300,000.00	0.88
4	000001	平安银行	5,650,486	93,120,009.28	0.86
5	600176	中国巨石	4,950,446	90,098,117.20	0.84

6	601009	南京银行	8,007,086	71,743,490.56	0.67
7	300750	宁德时代	120,500	70,854,000.00	0.66
8	600660	福耀玻璃	1,493,300	70,394,162.00	0.65
9	600887	伊利股份	1,620,600	67,190,076.00	0.62
10	002648	卫星化学	1,570,760	62,877,522.80	0.58

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	2,874,306,600.00	26.69
	其中：政策性金融债	2,332,178,600.00	21.65
4	企业债券	1,822,909,750.00	16.92
5	企业短期融资券	1,762,374,000.00	16.36
6	中期票据	1,465,669,500.00	13.61
7	可转债（可交换债）	216,935,941.44	2.01
8	同业存单	1,255,690,000.00	11.66
9	其他	-	-
10	合计	9,397,885,791.44	87.25

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	210402	21 农发 02	5,000,000	506,550,000.00	4.70
2	210215	21 国开 15	4,900,000	491,568,000.00	4.56
3	210210	21 国开 10	3,850,000	393,316,000.00	3.65
4	190203	19 国开 03	2,200,000	223,410,000.00	2.07
5	112104035	21 中国银行 CD035	2,000,000	194,880,000.00	1.81

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。

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

无。

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 21 交通银行 CD200（证券代码 112106200）、21 中国银行 CD035（证券代码 112104035）、兴业银行（证券代码 601166）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、21 交通银行 CD200（证券代码 112106200）

交通银行 2021 年 6 月 18 日公告称，因未按监管要求监测贷款资金用途，贷款资金回流部分转作银行承兑汇票保证金，中国银行保险监督管理委员会临沂监管分局对公司处以罚款 20 万元的处分。交通银行 2021 年 7 月 16 日公告称，因理财业务和同业业务制度不健全、

理财业务数据与事实不符等原因，中国银行保险监督管理委员会对公司处以罚款 4100 万元。交通银行 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处以罚款 62 万元的处分。

2、21 中国银行 CD035（证券代码 112104035）

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，被中国银行保险监督管理委员会共计罚没 8761.355 万元。

3、兴业银行（证券代码 601166）

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。

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	387,061.75
2	应收证券清算款	174,713,065.13
3	应收股利	-
4	应收利息	128,527,304.29
5	应收申购款	13,463,662.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	317,091,093.83

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	113042	上银转债	37,234,201.70	0.35
2	113026	核能转债	26,609,048.50	0.25
3	132015	18 中油 EB	17,668,100.00	0.16
4	132018	G 三峡 EB1	16,788,000.00	0.16
5	113024	核建转债	13,102,500.90	0.12

6	110077	洪城转债	12,700,530.00	0.12
7	110073	国投转债	12,172,251.60	0.11
8	132009	17 中油 EB	9,403,200.00	0.09
9	128135	洽洽转债	7,193,050.00	0.07
10	127017	万青转债	3,801,300.00	0.04
11	113619	世运转债	3,511,000.00	0.03
12	113044	大秦转债	3,283,200.00	0.03
13	110056	亨通转债	3,074,199.70	0.03
14	128116	瑞达转债	2,988,000.00	0.03
15	128035	大族转债	2,686,600.00	0.02
16	110053	苏银转债	2,367,200.00	0.02
17	128083	新北转债	2,350,200.00	0.02
18	128136	立讯转债	2,272,140.00	0.02
19	113605	大参转债	922,062.40	0.01

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	南方安泰混合 A	南方安泰混合 C
报告期期初基金份额总额	9,961,586,717.47	52,263,604.05
报告期期间基金总申购份额	811,349,290.96	126,301,194.78
减：报告期期间基金总赎回份额	1,429,441,555.32	33,803,266.00
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	9,343,494,453.11	144,761,532.83

§ 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、《南方安泰混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方安泰混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、南方安泰混合型证券投资基金 2021 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>