

# 南方绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年第 2 季度报告

2024 年 06 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 7 月 19 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 2024 年 7 月 17 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 南方绝对收益策略定开混合发起   |
| 基金主代码      | 000844   |
| 交易代码       | 000844   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2014 年 12 月 1 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 59,056,808.98 份  |
| 投资目标       | 灵活应用多种绝对收益策略对冲本基金的系统性风险，寻求基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略       | 本基金力争通过合理判断市场走势，合理配置股票、股指期货、债券等投资工具的比例，本基金主要采用市场中性的投资策略，通过定量和定性相结合的方法精选个股，并通过卖出股指期货合约对冲系统性风险，力争实现稳定的绝对回报。<br>本基金投资策略主要包括：资产配置策略、多头投资策略、空头工具投资策略、其他绝对收益策略、风险控制策略、债券投资策略、中小企业私募债投资策略、权证投资策略。 |
| 业绩比较基准     | 中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率(税后)+2%  |
| 风险收益特征     | 本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证   |

|       |                     |
|-------|---------------------|
|       | 一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。 |
| 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        |

### § 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 4 月 1 日—2024 年 6 月 30 日） |
|----------------|-------------------------------------|
| 1.本期已实现收益      | -822,783.29                         |
| 2.本期利润         | 784,604.72                          |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0128                              |
| 4.期末基金资产净值     | 79,305,868.26                       |
| 5.期末基金份额净值     | 1.3429                              |

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。

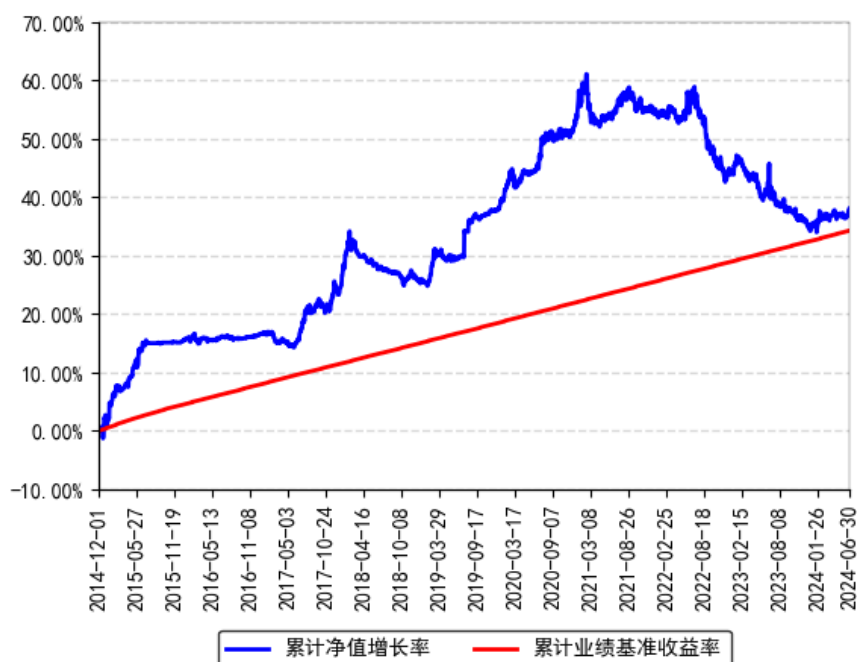
#### 3.2 基金净值表现

##### 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      | 1.00%    | 0.18%       | 0.65%      | 0.01%         | 0.35%   | 0.17% |
| 过去六个月      | 2.50%    | 0.26%       | 1.32%      | 0.01%         | 1.18%   | 0.25% |
| 过去一年       | -2.54%   | 0.28%       | 2.68%      | 0.01%         | -5.22%  | 0.27% |
| 过去三年       | -10.89%  | 0.35%       | 8.49%      | 0.01%         | -19.38% | 0.34% |
| 过去五年       | 6.54%    | 0.34%       | 15.00%     | 0.01%         | -8.46%  | 0.33% |
| 自基金合同生效起至今 | 38.14%   | 0.31%       | 34.28%     | 0.01%         | 3.86%   | 0.30% |

##### 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

南方绝对收益策略定开混合发起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 |        |   |
| 冯雨生 | 本基金基金经理 | 2021年11月12日 | -    | 16年    | 北京大学金融学硕士，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。曾就职于长盛基金管理有限公司，历任量化投资部量化研究员、部门负责人兼基金经理；2011年7月11日至2019年10月9日，任长盛中证100指数基金经理；2011年12月20日至2019年10月9日，任长盛沪深300指数基金经理；2015年4月27日至2017年10月23日，任长盛高端装备混合基金经理；2015年5月29日至2019年10月9日，任长盛中证申万一带一路指数分级基金经理；2015年6月18日至2020年10月23日，任长盛成长价值混合基金经理；2015年8月13日至2019年10月9日，任长盛中证全指证券指数基金经理；2016年9月12日至2019年8月12日，任长盛战略新兴产业混合 |

|     |              |                  |                 |      |  |
|-----|--------------|------------------|-----------------|------|--|
|     |              |                  |                 |      | <p>基金经理 2016 年 9 月 12 日至 2019 年 10 月 9 日，任长盛盛世混合基金经理；2016 年 9 月 12 日至 2021 年 6 月 17 日，任长盛积极配置债券基金经理；2017 年 3 月 17 日至 2019 年 10 月 9 日，任长盛同鑫行业配置混合基金经理；2017 年 5 月 3 日至 2019 年 10 月 9 日，任长盛信息安全量化策略混合基金经理；2017 年 10 月 23 日至 2020 年 4 月 21 日，任长盛同德主题混合基金经理；2020 年 4 月 15 日至 2021 年 1 月 20 日，任长盛价值发现股票基金经理；2019 年 3 月 18 日至 2021 年 6 月 17 日，任长盛量化多策略灵活配置混合、长盛量化红利混合、长盛多因子策略优选基金经理。2021 年 7 月加入南方基金，2021 年 11 月 12 日至今，任南方量化成长、南方中证 500 增强、南方绝对收益基金经理 2021 年 12 月 13 日至今，兼任投资经理；2022 年 5 月 13 日至今，任南方高股息股票基金经理；2023 年 6 月 16 日至今，任大数据 100 基金经理。</p>  |
| 李佳亮 | 本基金基金经理（已离任） | 2016 年 12 月 30 日 | 2024 年 5 月 31 日 | 11 年 | <p>美国南加州大学金融工程硕士，具有基金从业资格。2012 年 8 月加入南方基金，任量化投资部研究员；2015 年 5 月 28 日至 2016 年 8 月 5 日，任投资经理助理 2017 年 4 月 13 日至 2018 年 9 月 4 日，任南方荣优基金经理；2016 年 8 月 5 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方消费基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 6 月 28 日，任大数据 100、大数据 300 基金经理；2016 年 11 月 23 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方中证 500 增强基金经理 2017 年 11 月 9 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方量化成长基金经理；2020 年 4 月 23 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方上证 50 增强基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2024 年 5 月 31 日，任南方绝对收益基金经理；2021 年 10 月 29 日至今，任南方 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 基金经理 2022 年 1 月 10 日至今，任南方 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接基金经理；2022 年 11 月 21 日至今，兼任投资经理 2022 年 12 月 16 日至今，任南方基金南</p> |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | 方东英银河联昌富时亚太低碳精选 ETF (QDII) 基金经理; 2022 年 12 月 23 日至今, 任南方北证 50 成份指数发起基金经理; 2023 年 3 月 3 日至今, 任南方中证主要消费 ETF 基金经理; 2023 年 3 月 23 日至今, 任南方标普 500ETF (QDII) 基金经理; 2023 年 4 月 13 日至今, 任南方沪深 300ESG 基准 ETF 基金经理; 2023 年 6 月 21 日至今, 任南方中证国新央企科技引领 ETF 基金经理; 2023 年 7 月 28 日至今, 任南方中证通信服务 ETF 基金经理; 2023 年 9 月 7 日至今, 任南方中证 2000ETF 基金经理; 2023 年 12 月 5 日至今, 任南方中证电池主题指数发起基金经理; 2024 年 2 月 28 日至今, 任南方中证国新央企科技引领 ETF 联接基金经理; 2024 年 3 月 19 日至今, 任南方中证光伏产业指数发起基金经理; 2024 年 3 月 29 日至今, 任南方中证半导体产业指数发起基金经理; 2024 年 4 月 15 日至今, 任南方上证科创板芯片 ETF 基金经理; 2024 年 5 月 14 日至今, 任南方中证通信服务 ETF 发起联接基金经理; 2024 年 5 月 21 日至今, 任南方富时亚太低碳精选 ETF 发起联接 (QDII) 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             |
|-----|----------|----------|------------------|------------------|
| 冯雨生 | 公募基金     | 5        | 1,948,558,138.35 | 2011 年 07 月 11 日 |
|     | 私募资产管理计划 | -        | -                | -                |
|     | 其他组合     | -        | -                | -                |
|     | 合计       | 5        | 1,948,558,138.35 | -                |

#### 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 59 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

2024 年 2 季度，本基金通过分析市场走势，合理配置股票、股指期货、债券等投资工具的比例，主要采用市场中性的投资策略，通过定量和定性相结合的方法精选个股，并通过卖出股指期货合约对冲系统性风险。本基金资产配置策略主要是以宏观经济分析为重点，基于经济结构调整过程中相关政策与法规的变化、证券市场环境、金融市场利率变化、经济运行周期、投资者情绪以及证券市场不同类别资产的风险/收益状况等，判断宏观经济发展趋势、政策导向和证券市场的未来发展趋势，确定和构造合适的资产配置比例。通过定量和定性相结合的方法精选个股，主要需要考虑的方面包括上市公司治理结构、核心竞争优势、议价能力、市场占有率、成长性、盈利能力、运营效率、财务结构、现金流情况以及公司基本面变化等，并对上市公司的投资价值进行综合评价，精选具有较高投资价值的上市公司构建多头组合。

### 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 1.3429 元，报告期内，份额净值增长率为 1.00%，同期业绩基准增长率为 0.65%。

### 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              | 30,712,589.00 | 37.39        |
|    | 其中：股票             | 30,712,589.00 | 37.39        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 28,993,466.58 | 35.30        |
|    | 其中：债券             | 28,993,466.58 | 35.30        |
|    | 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      | 19,288,501.02 | 23.48        |
| 8  | 其他资产              | 3,147,055.71  | 3.83         |
| 9  | 合计                | 82,141,612.31 | 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         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 5,036,229.00  | 6.35         |
| C  | 制造业              | 12,262,065.00 | 15.46        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,930,519.00  | 3.70         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 521,703.00    | 0.66         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,110,755.00  | 1.40         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,575,930.00  | 1.99         |
| J  | 金融业              | 7,275,388.00  | 9.17         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -            |
| 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        | 30,712,589.00 | 38.73 |

### 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  | 600690 | 海尔智家 | 54,300  | 1,541,034.00 | 1.94         |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 44,300  | 1,514,617.00 | 1.91         |
| 3  | 600941 | 中国移动 | 9,900   | 1,064,250.00 | 1.34         |
| 4  | 601857 | 中国石油 | 100,400 | 1,036,128.00 | 1.31         |
| 5  | 600519 | 贵州茅台 | 700     | 1,027,173.00 | 1.30         |
| 6  | 600900 | 长江电力 | 34,900  | 1,009,308.00 | 1.27         |
| 7  | 603993 | 洛阳钼业 | 113,900 | 968,150.00   | 1.22         |
| 8  | 601398 | 工商银行 | 160,000 | 912,000.00   | 1.15         |
| 9  | 000063 | 中兴通讯 | 30,000  | 839,100.00   | 1.06         |
| 10 | 601899 | 紫金矿业 | 45,800  | 804,706.00   | 1.01         |

### 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      | 28,993,466.58 | 36.56        |
| 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） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 28,993,466.58 | 36.56        |

### 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  | 019721 | 23 国债 18 | 40,000 | 4,126,796.71 | 5.20         |
| 2  | 019725 | 23 国债 22 | 35,000 | 3,647,680.82 | 4.60         |
| 3  | 019730 | 23 国债 27 | 35,000 | 3,580,638.08 | 4.51         |
| 4  | 019702 | 23 国债 09 | 30,000 | 3,469,888.77 | 4.38         |
| 5  | 019726 | 23 国债 23 | 30,000 | 3,382,286.30 | 4.26         |

## 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

金额单位：人民币元

| 代码                | 名称     | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元）        | 公允价值变动（元）  | 风险说明        |
|-------------------|--------|----------|----------------|------------|-------------|
| IF2407            | IF2407 | -10      | -10,311,000.00 | 124,963.64 | -           |
| IF2409            | IF2409 | -14      | -14,379,120.00 | 429,360.00 | -           |
| IH2408            | IH2408 | -2       | -1,416,360.00  | -3,660.00  | -           |
| 公允价值变动总额合计（元）     |        |          |                |            | 550,663.64  |
| 股指期货投资本期收益（元）     |        |          |                |            | -545,769.08 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |        |          |                |            | 685,063.29  |

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，力争获得稳定的正向超额收益。

## 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 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 30,712,589.00 元，占基金资产净值的比例为 38.73%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 26,106,480.00 元，占基金资产净值的比例为 32.92%，空头合约市值占股票资产的比例为 85.00%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-1,163,756.99 元，公允价值变动损益为 1,347,809.25 元。

## 5.12 投资组合报告附注

### 5.12.1 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。

### 5.12.2 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。

### 5.12.3 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   | 3,147,055.71 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 8 | 其他 | -            |
| 9 | 合计 | 3,147,055.71 |

#### 5.12.4 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。

#### 5.12.5 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               | 61,801,471.85 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 2,312.93      |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 2,746,975.80  |
| 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               | 59,056,808.98 |

### § 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数       | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限      |
|-------------|--------|-----------------|--------------|-----------------|-----------------|
| 基金管理人固有资金   | -      | -               | 9,008,567.10 | 15.25           | 自合同生效之日起不少于 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | -      | -               | -            | -               | -               |
| 基金经理等       | -      | -               | 207,709.38   | 0.35            | 自合同生效           |

|             |      |      |              |       |            |
|-------------|------|------|--------------|-------|------------|
| 人员          |      |      |              |       | 之日起不少于 3 年 |
| 基金管理人<br>股东 | -    | -    | -            | -     | -          |
| 其他          | -    | -    | -            | -     | -          |
| 合计          | 0.00 | 0.00 | 9,216,276.48 | 15.61 | -          |

注：上述份额总数均包含利息结转份额。

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、《南方绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、南方绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年 2 季度报告原文。

### 10.2 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。

### 10.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>