

# 南方中小盘成长股票型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.8 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.....	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	38
7.12 投资组合报告附注 .....	38
§8 基金份额持有人信息 .....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	39
§9 开放式基金份额变动 .....	39
§10 重大事件揭示 .....	40
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	40
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	40
10.4 基金投资策略的改变 .....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	40
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	40
10.8 其他重大事件 .....	42
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	43
11.1 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 .....	43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	43
§12 备查文件目录 .....	43
12.1 备查文件目录 .....	43
12.2 存放地点 .....	43
12.3 查阅方式 .....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方中小盘成长股票型证券投资基金
基金简称	南方中小盘成长股票
基金主代码	000326
交易代码	000326
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 3 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	114,603,731.25 份
基金合同存续期	不定期

注：1、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“南方中小盘成长”。

2、本基金转型日期为 2018 年 11 月 3 日，该日起原南方顺达保本混合型证券投资基金正式变更为南方中小盘成长股票型证券投资基金。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过对具备良好成长潜力及合理估值水平的中小盘股票的投资，在有效控制组合风险的基础上，力争持续实现超越业绩基准的超额收益。
投资策略	本基金为股票型证券投资基金，将采用“自上而下”的策略进行基金的大类资产配置。本基金主要通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、利率走势、证券市场估值水平等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，分析股票市场、债券市场、现金等大类资产的预期风险和收益，动态调整基金大类资产的投资比例，以控制系统性风险。
业绩比较基准	业绩基准收益率=80%×中证 700 指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。本基金主要投资于中小盘股票，在股票型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.
		郭明
		010-66105799
		custody@icbc.com.cn

		com	
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼		北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼		北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518017	100140
法定代表人		张海波	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	16,333,329.56
本期利润	23,034,574.68
加权平均基金份额本期利润	0.1876
本期加权平均净值利润率	14.74%
本期基金份额净值增长率	15.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	33,153,300.86
期末可供分配基金份额利润	0.2892
期末基金资产净值	164,603,026.73
期末基金份额净值	1.4363
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	44.70%
-------------	--------

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

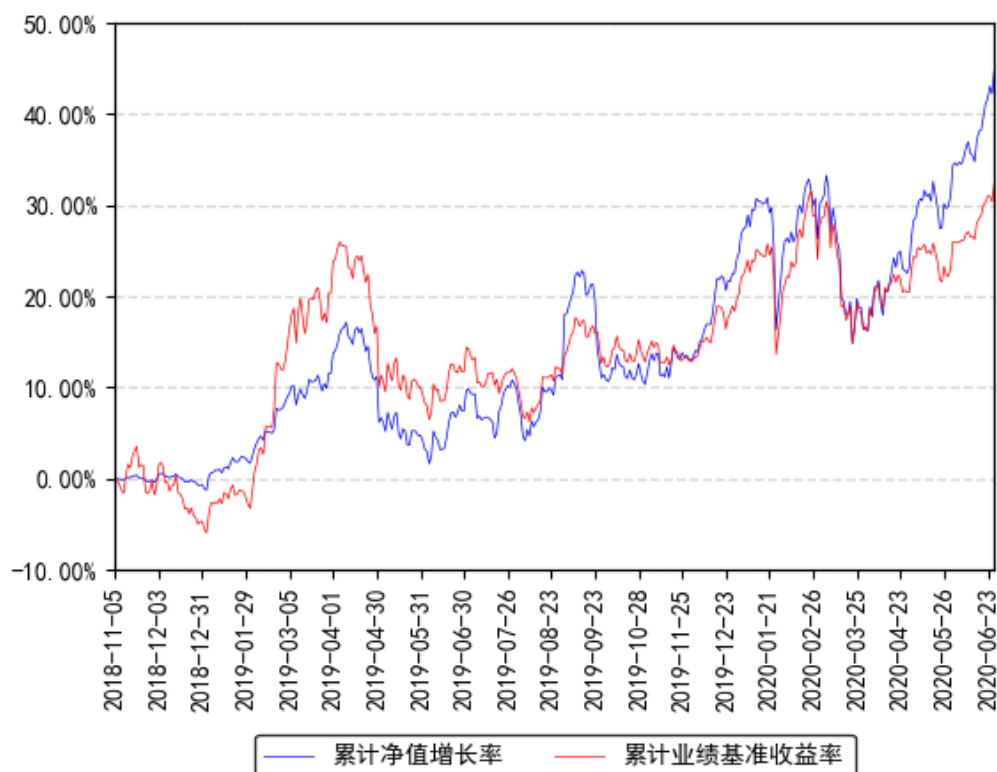
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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
过去一个月	10.36%	0.85%	7.56%	0.71%	2.80%	0.14%
过去三个月	24.24%	1.10%	13.53%	0.88%	10.71%	0.22%
过去六个月	15.95%	1.55%	10.07%	1.39%	5.88%	0.16%
过去一年	34.74%	1.26%	18.51%	1.13%	16.23%	0.13%
自基金转型至今	44.70%	1.10%	32.34%	1.20%	12.36%	-0.10%

### 3.2.2 自基金转型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

南方中小盘成长股票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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日,经中国证监会批准,南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立,成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018年1月,公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019年7月,根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议,并经中国证监会核准,本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本,认购完成后注册资本为36172万元人民币。目前股权结构为:华泰证券股份有限公司41.16%、深圳市投资控股有限公司27.44%、厦门国际信托有限公司13.72%、兴业证券股份有限公司9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)2.20%。目前,公司总部设在深圳,在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司,在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中,南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。



截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 10000 亿元，旗下管理 220 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴剑毅	本基金基金经理	2018年11月3日	-	11年	清华大学金融学硕士，具有基金从业资格。2009年7月加入南方基金，任南方基金研究部金融行业研究员；2012年3月15日至2014年7月18日，担任南方避险、南方保本基金经理助理；2015年11月26日至2017年12月2日，任南方顺康保本基金经理；2014年7月18日至2018年1月16日，任南方恒元基金经理；2015年9月11日至2018年11月28日，任南方消费活力基金经理；2015年10月28日至2018年11月3日，任南方顺达保本基金经理；2017年8月3日至2019年1月25日，任南方金融混合基金经理；2017年12月2日至2020年5月15日，任南方顺康混合基金经理；2018年2月6日至2020年5月15日，任南方安养混合基金经理；2015年5月21日至今，任南方利众基金经理；2015年7月8日至今，任南方利达基金经理；2015年11月19日至今，任南方利安基金经理；2016年12月14日至今，任南方安颐混合基金经理；2017年11月2日至今，任南方安福混合基金经理；2018年11月3日至今，任南方中小盘成长股票基金经理；2019年1月25日至今，任南方新蓝筹混合基金经理；2020年4月29日至今，任南方誉慧一年混合基金经理。
姚万宁	本基金基金经理助理	2018年11月3日	-	7年	深圳大学金融学硕士，具有基金从业资格。2012年7月加入南方基金，担任投资部投资账户助理；2015年11月至2017年12月，任南方顺康保本基金经理助理；2015年11月至2018年1月，任南方恒元基金经理助理；2015年11月至2018年11月，任南方顺达基金经理助理；2015年11月至今，任南方利众、南方利达、

					南方利安基金经理助理; 2016 年 12 月至今, 任南方安颐混合基金经理助理; 2017 年 12 月至今, 任南方顺康混合基金经理助理; 2018 年 1 月至今, 任南方中证 100 基金经理助理; 2018 年 11 月至今, 任南方中小盘成长股票基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

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。

## 4.2 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最大利益。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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内, 两两组间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在, 并且交易占比也没有明显异常, 未发现不公平对待各组合或组间相互利益输送的情况。

### 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, 是由于接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，股票市场先抑后扬。受疫情和经济停摆影响，一季度市场出现了深度调整。二季度以来，随着疫情得到有效控制和复工复产的推进，经济数据恢复态势明显。叠加积极的财政政策和宽松的货币政策，以及内外资加速流入股市，市场迎来全面反弹。尽管期间也经历了国际冲突的加剧以及疫情的反复，但市场依旧波澜不惊，保持较强的稳定性。

报告期内上证综指下跌 2.15%，创业板指上涨 35.6%，沪深 300 指数上涨 1.64%。我们保持了相对较高的股票仓位，重点选取未来业绩成长确定性和持续性相对较高的优质公司。结合市场环境，我们重点配置于消费升级、科技创新、生物医药等板块。另外，对于短期受到疫情冲击，但长期竞争力依旧持续的优质公司，我们也持续给予很大的重视。

#### 4.4.2 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 1.4363 元，报告期内，份额净值增长率为 15.95%，同期业绩基准增长率为 10.07%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，疫情及国际关系的走向仍是决定国内外经济形势的重要变量。尽管以中国为代表的部分国家在疫情控制上取得了积极进展，但当前疫情在海外整体仍处于蔓延趋势中。与此同时，随着美国大选的临近，中美在经贸及科技等领域也出现了频繁摩擦。

尽管仍存在众多不确定性，但我们对于下半年市场表现仍相对乐观。充裕的流动性仍是支持股市上涨的最直接原因，内外资都在以各种形式积极提升股市的配置，特别是居民理财为代表的内资，通过申购公募基金的形式积极流入股市。在此大背景下，A 股的估值中枢有望获得系统性提升，板块轮动也将加快。我们重点看好长期商业模式较好，同时在行业内具备较高护城河的优质公司。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机

构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金合同生效满 1 年后，若基金在 6 月份和 12 月份最后一个交易日收盘后每份基金份额可分配利润金额高于 0.04 元(含)，则基金须在 15 个工作日之内进行收益分配，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%；本基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本基金本报告期内 2020 年 1 月 16 日已分配数（每 10 份基金份额派发红利 0.50 元）为 2019 年年度收益分配。

#### 4.8 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 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方中小盘成长股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报

报告期内，南方中小盘成长股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 7,097,892.52 元。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2020 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：南方中小盘成长股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	11,946,287.55	17,240,614.20
结算备付金		295,739.91	374,349.95
存出保证金		49,003.36	53,424.28
交易性金融资产	6.4.3.2	153,823,490.06	165,133,383.51
其中：股票投资		144,906,290.06	155,013,383.51
基金投资		-	-
债券投资		8,917,200.00	10,120,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		1,591,220.55	1,242,073.21
应收利息	6.4.3.5	21,384.42	134,337.27
应收股利		-	-
应收申购款		1,704,754.39	1,108,318.45
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		169,431,880.24	185,286,500.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,346,258.67	-
应付赎回款		950,094.00	405,137.92
应付管理人报酬		191,884.87	224,721.03
应付托管费		31,980.79	37,453.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	218,217.43	195,793.75
应交税费		6.90	0.71
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	90,410.85	180,625.70
负债合计		4,828,853.51	1,043,732.61
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	114,603,731.25	143,203,021.09
未分配利润	6.4.3.10	49,999,295.48	41,039,747.17
所有者权益合计		164,603,026.73	184,242,768.26
负债和所有者权益总计		169,431,880.24	185,286,500.87

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4363 元，基金份额总额 114,603,731.25 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方中小盘成长股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		25,359,295.06	17,964,227.35
1. 利息收入		150,416.96	1,219,395.52
其中：存款利息收入	6.4.3.11	29,935.01	58,636.03
债券利息收入		120,481.95	893,192.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	267,566.85
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		18,338,003.52	13,964,573.71
其中：股票投资收益	6.4.3.12	16,917,375.73	11,513,884.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	286,233.54	294,679.46
资产支持证券投资	6.4.3.14	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.3.15	-	-
衍生工具收益	6.4.3.16	-	-
股利收益	6.4.3.17	1,134,394.25	2,156,009.30
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	6,701,245.12	2,619,638.77
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	169,629.46	160,619.35
减：二、费用		2,324,720.38	2,875,742.69
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	1,170,898.21	1,488,964.76
2. 托管费	6.4.6.2.2	195,149.70	248,160.81
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	-	-

4. 交易费用	6. 4. 3. 20	850,064.13	1,028,691.17
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.74	1,303.95
7. 其他费用	6. 4. 3. 21	108,607.60	108,622.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,034,574.68	15,088,484.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,034,574.68	15,088,484.66

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中小盘成长股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	143,203,021.09	41,039,747.17	184,242,768.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,034,574.68	23,034,574.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-28,599,289.84	-6,977,133.85	-35,576,423.69
其中：1. 基金申购款	36,868,468.13	10,438,149.90	47,306,618.03
2. 基金赎回款	-65,467,757.97	-17,415,283.75	-82,883,041.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填	-	-7,097,892.52	-7,097,892.52



列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	114,603,731.25	49,999,295.48	164,603,026.73
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	198,608,307.35	4,729,156.44	203,337,463.79
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	15,088,484.66	15,088,484.66
三、本期基金份额交 易产生的基金净值变 动数(净值减少以 “-”号填列)	-30,415,959.16	-1,794,223.03	-32,210,182.19
其中: 1. 基金申购款	47,677,183.61	6,350,229.78	54,027,413.39
2. 基金赎回款	-78,093,142.77	-8,144,452.81	-86,237,595.58
四、本期向基金份额 持有人分配利润产生 的基金净值变动(净 值减少以“-”号填 列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	168,192,348.19	18,023,418.07	186,215,766.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

\_\_\_\_\_ 杨小松 \_\_\_\_\_ 徐超 \_\_\_\_\_ 徐超 \_\_\_\_\_  
 基金管理人负责人      主管会计工作负责人      会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策, 会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	11,946,287.55
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	11,946,287.55

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	132,731,227.66	144,906,290.06	12,175,062.40	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	8,921,385.00	8,917,200.00	-4,185.00
	合计	8,921,385.00	8,917,200.00	-4,185.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	141,652,612.66	153,823,490.06	12,170,877.40	

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,272.32
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	119.70
应收债券利息	19,972.60
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	19.80
合计	21,384.42

#### 6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	218,044.93
银行间市场应付交易费用	172.50
合计	218,217.43

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	903.25
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,507.60
其他	-
合计	90,410.85

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	143,203,021.09	143,203,021.09
本期申购	36,868,468.13	36,868,468.13
本期赎回（以“-”号填列）	-65,467,757.97	-65,467,757.97
基金拆分/份额折算前	-	-

基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	114,603,731.25	114,603,731.25

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,343,558.75	10,696,188.42	41,039,747.17
本期利润	16,333,329.56	6,701,245.12	23,034,574.68
本期基金份额交易产生的变动数	-6,425,694.93	-551,438.92	-6,977,133.85
其中：基金申购款	8,791,559.28	1,646,590.62	10,438,149.90
基金赎回款	-15,217,254.21	-2,198,029.54	-17,415,283.75
本期已分配利润	-7,097,892.52	-	-7,097,892.52
本期末	33,153,300.86	16,845,994.62	49,999,295.48

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	26,322.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,106.53
其他	506.41
合计	29,935.01

#### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	289,988,699.63
减：卖出股票成本总额	273,071,323.90
买卖股票差价收入	16,917,375.73

#### 6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	11,647,805.06
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,110,350.00

减：应收利息总额	251,221.52
买卖债券差价收入	286,233.54

#### 6.4.3.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.3.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

#### 6.4.3.16 衍生工具收益

##### 6.4.3.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 6.4.3.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

#### 6.4.3.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,134,394.25
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,134,394.25

#### 6.4.3.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	6,701,245.12
——股票投资	6,734,180.12
——债券投资	-32,935.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	6,701,245.12

#### 6.4.3.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	158,386.61
基金转换费收入	11,242.85
合计	169,629.46

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.3.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	849,891.63
银行间市场交易费用	172.50
合计	850,064.13

#### 6.4.3.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	500.00
合计	108,607.60

### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2020 年 7 月 10 日宣告分红，每 10 份基金份额派发红利 0.6000 元。

### 6.4.5 关联方关系

#### 6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	299,692,275.62	55.32%	108,030,484.21	15.14%

#### 6.4.6.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	273,064.40	55.31%	117,282.70	53.79%
关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	98,449.34	15.14%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 6.4.6.2 关联方报酬

#### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,170,898.21	1,488,964.76
其中：支付销售机构的客户	229,141.33	294,554.72

维护费		
-----	--	--

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	195,149.70	248,160.81

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.6.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.6.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。



**6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	11,946,287.55	26,322.07	16,311,731.43	41,565.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

**6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.6.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.7 利润分配情况**

单位：人民币元

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2020 年 1 月 16 日	-	2020 年 1 月 16 日	0.5000	6,444,772.22	653,120.30	7,097,892.52	-
合计	-	-	-	0.5000	6,444,772.22	653,120.30	7,097,892.52	-

**6.4.8 期末（2020 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-

300846	首都在线	2020年 6月22 日	2020年 7月1 日	新股未 上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年 6月29 日	2020年 7月9 日	新股未 上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688027	国盾量子	2020年 6月30 日	2020年 7月9 日	新股未 上市	36.18	36.18	1,934	69,972.12	69,972.12	-
688081	兴图新科	2019年 12月26 日	2020年 7月6 日	科创板 新股锁 定期	28.21	42.01	3,153	88,946.13	132,457.53	-
688085	三友医疗	2020年 3月30 日	2020年 10月9 日	科创板 新股锁 定期	20.96	67.62	3,816	79,983.36	258,037.92	-
688200	华峰测控	2020年 2月11 日	2020年 8月18 日	科创板 新股锁 定期	107.4 1	270.0 2	1,176	126,314.16	317,543.52	-
688208	道通科技	2020年 2月6 日	2020年 8月13 日	科创板 新股锁 定期	24.36	54.23	5,218	127,110.48	282,972.14	-
688568	中科星图	2020年 6月30 日	2020年 7月8 日	新股未 上市	16.21	16.21	6,336	102,706.56	102,706.56	-
688600	皖仪科技	2020年 6月23 日	2020年 7月3 日	新股未 上市	15.50	15.50	4,283	66,386.50	66,386.50	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

## 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.9 金融工具风险及管理

### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.8 此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资和应收申购款等。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
银行存款	11,946,287.55	-	-	-	11,946,287.55
结算备付金	295,739.91	-	-	-	295,739.91
存出保证金	49,003.36	-	-	-	49,003.36
交易性金融资产	8,917,200.00	-	-	144,906,290.06	153,823,490.06
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	21,384.42	21,384.42
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	54,348.00	-	-	1,650,406.39	1,704,754.39
应收证券清算款	-	-	-	1,591,220.55	1,591,220.55
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	21,262,578.82	-	-	148,169,301.42	169,431,880.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	950,094.00	950,094.00
应付管理人报酬	-	-	-	191,884.87	191,884.87
应付托管费	-	-	-	31,980.79	31,980.79
应付证券清算款	-	-	-	3,346,258.67	3,346,258.67
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	218,217.43	218,217.43
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6.90	6.90
其他负债	-	-	-	90,410.85	90,410.85
负债总计	-	-	-	4,828,853.51	4,828,853.51
利率敏感度缺口	21,262,578.82	-	-	143,340,447.91	164,603,026.73
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,240,614.20	-	-	-	17,240,614.20
结算备付金	374,349.95	-	-	-	374,349.95

存出保证金	53,424.28	-	-	-	53,424.28
交易性金融资产	10,013,000.00	-	107,000.00	155,013,383.51	165,133,383.51
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	134,337.27	134,337.27
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	2,350.00	-	-	1,105,968.45	1,108,318.45
应收证券清算款	-	-	-	1,242,073.21	1,242,073.21
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	27,683,738.43	-	107,000.00	157,495,762.44	185,286,500.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	405,137.92	405,137.92
应付管理人报酬	-	-	-	224,721.03	224,721.03
应付托管费	-	-	-	37,453.50	37,453.50
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	195,793.75	195,793.75
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.71	0.71
其他负债	-	-	-	180,625.70	180,625.70
负债总计	-	-	-	1,043,732.61	1,043,732.61
利率敏感度缺口	27,683,738.43	-	107,000.00	156,452,029.83	184,242,768.26

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.42% (2019 年 12 月 31 日：5.49%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2019 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 80-95%，其中投资于具有高成长性、基本面良好的中小盘股票的资产合计不低于非现金资产的 80%；债券、中期票据、权证、货币市场工具、资产支持证券及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 5-20%，基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产- 股票投资	144,906,290.06	88.03	155,013,383.51	84.14
交易性金融资产- 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产- 贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权 证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	144,906,290.06	88.03	155,013,383.51	84.14

##### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析



假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 上升 5%	7,551,289.23	7,142,319.15
	2. 沪深 300 下降 5%	-7,551,289.23	-7,142,319.15

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	144,906,290.06	85.52
	其中：股票	144,906,290.06	85.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,917,200.00	5.26
	其中：债券	8,917,200.00	5.26
	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	12,242,027.46	7.23
8	其他资产	3,366,362.72	1.99
9	合计	169,431,880.24	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	9,109,805.00	5.53
B	采矿业	-	-
C	制造业	85,971,176.42	52.23

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	1,572,585.00	0.96
F	批发和零售业	13,591,279.00	8.26
G	交通运输、仓储和邮政业	6,809,245.00	4.14
H	住宿和餐饮业	1,564,666.00	0.95
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,871,201.12	7.82
J	金融业	9,893,464.00	6.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,636,441.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	1,873,661.20	1.14
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	144,906,290.06	88.03

### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600176	中国巨石	650,200	5,949,330.00	3.61
2	603589	口子窖	106,500	5,420,850.00	3.29
3	002597	金禾实业	227,434	5,224,158.98	3.17
4	002299	圣农发展	140,800	4,083,200.00	2.48
5	601607	上海医药	213,100	3,916,778.00	2.38
6	002459	晶澳科技	204,800	3,846,144.00	2.34
7	000998	隆平高科	216,500	3,604,725.00	2.19
8	002867	周大生	158,000	3,502,860.00	2.13
9	603232	格尔软件	111,226	3,425,760.80	2.08
10	000028	国药一致	72,800	3,276,728.00	1.99
11	600233	圆通速递	224,400	3,267,264.00	1.98
12	000513	丽珠集团	67,900	3,259,879.00	1.98
13	601966	玲珑轮胎	157,900	3,189,580.00	1.94
14	601128	常熟银行	408,400	3,067,084.00	1.86
15	603368	柳药股份	126,140	2,894,913.00	1.76
16	601577	长沙银行	295,400	2,345,476.00	1.42
17	601838	成都银行	290,200	2,309,992.00	1.40
18	601997	贵阳银行	303,200	2,170,912.00	1.32

19	688126	沪硅产业	62,299	2,135,609.72	1.30
20	300136	信维通信	38,200	2,025,364.00	1.23
21	603690	至纯科技	47,000	1,944,860.00	1.18
22	300207	欣旺达	102,300	1,933,470.00	1.17
23	600872	中炬高新	33,000	1,931,490.00	1.17
24	600745	闻泰科技	15,000	1,889,250.00	1.15
25	300132	青松股份	80,200	1,852,620.00	1.13
26	002371	北方华创	10,500	1,794,555.00	1.09
27	300450	先导智能	38,486	1,778,438.06	1.08
28	300618	寒锐钴业	28,500	1,767,570.00	1.07
29	300010	立思辰	89,200	1,745,644.00	1.06
30	002777	久远银海	57,340	1,743,709.40	1.06
31	300482	万孚生物	16,700	1,736,800.00	1.06
32	603369	今世缘	43,056	1,713,198.24	1.04
33	300760	迈瑞医疗	5,600	1,711,920.00	1.04
34	600216	浙江医药	88,600	1,706,436.00	1.04
35	300248	新开普	138,000	1,705,680.00	1.04
36	300078	思创医惠	123,300	1,668,249.00	1.01
37	603697	有友食品	81,400	1,642,652.00	1.00
38	002008	大族激光	45,676	1,642,052.20	1.00
39	002127	南极电商	77,300	1,636,441.00	0.99
40	002912	中新赛克	10,000	1,635,900.00	0.99
41	000860	顺鑫农业	28,630	1,631,337.40	0.99
42	300463	迈克生物	28,000	1,630,440.00	0.99
43	603899	晨光文具	29,400	1,605,240.00	0.98
44	600636	国新文化	128,700	1,583,010.00	0.96
45	600426	华鲁恒升	89,000	1,573,520.00	0.96
46	600068	葛洲坝	264,300	1,572,585.00	0.96
47	603885	吉祥航空	172,530	1,570,023.00	0.95
48	000425	徐工机械	265,400	1,568,514.00	0.95
49	002212	南洋股份	58,900	1,565,562.00	0.95
50	600258	首旅酒店	101,800	1,564,666.00	0.95
51	300567	精测电子	22,302	1,522,111.50	0.92
52	002233	塔牌集团	123,523	1,485,981.69	0.90
53	600004	白云机场	97,200	1,481,328.00	0.90
54	002714	牧原股份	17,340	1,421,880.00	0.86
55	300639	凯普生物	21,500	1,116,495.00	0.68
56	603259	药明康德	11,032	1,065,691.20	0.65
57	300791	仙乐健康	13,200	1,055,208.00	0.64
58	002985	北摩高科	7,900	983,313.00	0.60
59	688018	乐鑫科技	4,282	880,379.20	0.53
60	002078	太阳纸业	89,600	852,992.00	0.52
61	002847	盐津铺子	8,900	847,458.00	0.51

62	002439	启明星辰	20,137	847,163.59	0.51
63	300529	健帆生物	12,100	840,950.00	0.51
64	603186	华正新材	16,600	826,182.00	0.50
65	000547	航天发展	59,800	817,466.00	0.50
66	002507	涪陵榨菜	22,700	817,427.00	0.50
67	000988	华工科技	33,400	815,962.00	0.50
68	300149	量子生物	43,000	807,970.00	0.49
69	000063	中兴通讯	20,100	806,613.00	0.49
70	002353	杰瑞股份	25,400	787,400.00	0.48
71	300113	顺网科技	30,400	772,160.00	0.47
72	000625	长安汽车	70,100	771,100.00	0.47
73	601233	桐昆股份	58,500	746,460.00	0.45
74	000830	鲁西化工	94,500	704,970.00	0.43
75	002928	华夏航空	32,600	490,630.00	0.30
76	688200	华峰测控	1,176	317,543.52	0.19
77	688208	道通科技	5,218	282,972.14	0.17
78	688085	三友医疗	3,816	258,037.92	0.16
79	688081	兴图新科	3,153	132,457.53	0.08
80	688568	中科星图	6,336	102,706.56	0.06
81	688027	国盾量子	1,934	69,972.12	0.04
82	688600	皖仪科技	4,283	66,386.50	0.04
83	603087	甘李药业	495	49,648.50	0.03
84	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.02
85	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
86	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
87	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
88	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.01
89	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
90	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
91	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000998	隆平高科	4,116,052.00	2.23
2	600233	圆通速递	4,083,482.00	2.22
3	601607	上海医药	3,845,416.02	2.09
4	603589	口子窖	3,739,189.00	2.03
5	603232	格尔软件	3,578,644.78	1.94
6	002174	游族网络	3,401,158.90	1.85

7	002127	南极电商	3,374,958.00	1.83
8	002867	周大生	3,297,563.38	1.79
9	002008	大族激光	3,201,749.65	1.74
10	300078	思创医惠	3,184,565.20	1.73
11	600007	中国国贸	3,169,811.55	1.72
12	000513	丽珠集团	3,162,765.96	1.72
13	000961	中南建设	3,153,419.00	1.71
14	002299	圣农发展	3,133,735.00	1.70
15	601997	贵阳银行	3,114,093.00	1.69
16	601966	玲珑轮胎	3,110,697.28	1.69
17	002459	晶澳科技	3,095,788.00	1.68
18	601128	常熟银行	3,004,472.00	1.63
19	002353	杰瑞股份	2,949,614.50	1.60
20	600258	首旅酒店	2,907,631.72	1.58

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002614	奥佳华	8,362,095.03	4.54
2	600511	国药股份	7,705,958.12	4.18
3	600068	葛洲坝	7,184,293.00	3.90
4	000887	中鼎股份	5,516,566.00	2.99
5	002127	南极电商	4,423,821.92	2.40
6	002327	富安娜	4,393,376.02	2.38
7	601838	成都银行	4,377,103.00	2.38
8	601577	长沙银行	3,806,491.00	2.07
9	300078	思创医惠	3,594,504.50	1.95
10	600183	生益科技	3,569,008.20	1.94
11	600757	长江传媒	3,416,599.00	1.85
12	600258	首旅酒店	3,414,181.00	1.85
13	600373	中文传媒	3,202,352.00	1.74
14	000961	中南建设	3,130,437.54	1.70
15	000543	皖能电力	3,120,696.86	1.69
16	600867	通化东宝	3,120,113.00	1.69
17	600007	中国国贸	3,088,107.73	1.68
18	300474	景嘉微	3,048,367.00	1.65
19	300709	精研科技	2,934,672.10	1.59
20	688111	金山办公	2,927,346.29	1.59

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	256,230,050.33
卖出股票收入（成交）总额	289,988,699.63

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 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	8,917,200.00	5.42
	其中：政策性金融债	8,917,200.00	5.42
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	8,917,200.00	5.42

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	200403	20 农发 03	90,000	8,917,200.00	5.42

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1 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。

**7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	49,003.36
2	应收证券清算款	1,591,220.55

3	应收股利	-
4	应收利息	21,384.42
5	应收申购款	1,704,754.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,366,362.72

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
8,850	12,949.57	10,135.18	0.01%	114,593,596.07	99.99%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	300,310.36	0.2620%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 9 开放式基金份额变动



单位：份

基金合同生效日(2018年11月3日)基金份额总额	324,584,179.37
本报告期期初基金份额总额	143,203,021.09
本报告期基金总申购份额	36,868,468.13
减：报告期基金总赎回份额	65,467,757.97
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	114,603,731.25

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	299,692,275.62	55.32%	273,064.40	55.31%	-
瑞银证券	1	149,425,044.72	27.58%	136,168.44	27.58%	-
安信证券	1	46,331,576.12	8.55%	42,221.49	8.55%	-
方正证券	1	27,349,023.33	5.05%	24,923.28	5.05%	-
海通证券	1	15,841,951.35	2.92%	14,436.04	2.92%	-
国金证券	1	3,136,343.90	0.58%	2,857.74	0.58%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

**A：选择标准**

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

**B：选择流程** 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	1,148,033.06	82.19%	-	-	-	-
瑞银证券	222,704.40	15.94%	-	-	-	-
安信证券	26,067.60	1.87%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于旗下部分基金增加中国人寿为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-10
2	南方中小盘成长股票型证券投资基金限制大额申购、定投和转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-14
3	南方中小盘成长股票型证券投资基金分红公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-14
4	南方中小盘成长股票型证券投资基金恢复大额申购、定投和转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-17
5	南方基金管理股份有限公司旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-20
6	南方基金关于旗下部分基金增加东方财富证券为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-10
7	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-17
8	南方基金关于旗下部分基金增加和耕传承为销	证券时报、基金管理	2020-03-30

	售机构的公告	人网站、中国证监会 基金电子披露网站	
9	南方基金管理股份有限公司关于长春农村商业银行股份有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2020-06-05

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中小盘成长股票型证券投资基金的文件；
- 2、《南方中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中小盘成长股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中小盘成长股票型证券投资基金 2020 年中期报告》原文。

### 12.2 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。

### 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>