

# 南方浩睿进取京选 3 个月持有期混合 型基金中基金 (FOF) 2021 年第 2 季度报 告

2021 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 7 月 21 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7月19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4月20日（基金合同生效日）起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)
基金主代码	011696
交易代码	011696
基金运作方式	其他开放式
基金合同生效日	2021年4月20日
报告期末基金份额总额	1,121,108,179.72份
投资目标	本基金是基金中基金，优选多种具有不同风险收益特征的基金，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，合理配置基金、股票、债券等投资工具的比例，通过定量和定性相结合的方法精选具有不同风险收益特征的基金，力争实现基金资产的稳定回报。本基金的主要投资策略为基金投资策略，本基金在开放式基金投资方面，基于南方基金基金评价系统对全市场基金公司及其管理的基金的评级，将力求投资于管理规范、业绩优良的基金管理公司的基金，以分享资本市场的成长。
业绩比较基准	万得偏股混合型基金指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金中基金、债券型基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)A	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)C
下属分级基金的交易代码	011696	011697
报告期末下属分级基金的份额总额	1,096,998,147.51份	24,110,032.21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“南方浩睿FOF”。

### §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	2021年4月20日(基金合同生效日)-2021年6月30日	
	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)A	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)C
1.本期已实现收益	1,280,262.29	9,741.30
2.本期利润	27,623,503.17	585,915.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0252	0.0249
4.期末基金资产净值	1,124,626,484.82	24,698,060.40
5.期末基金份额净值	1.0252	1.0244

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、本基金合同于2021年4月20日生效，截至本报告期末基金成立未满一季度。

#### 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

南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)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

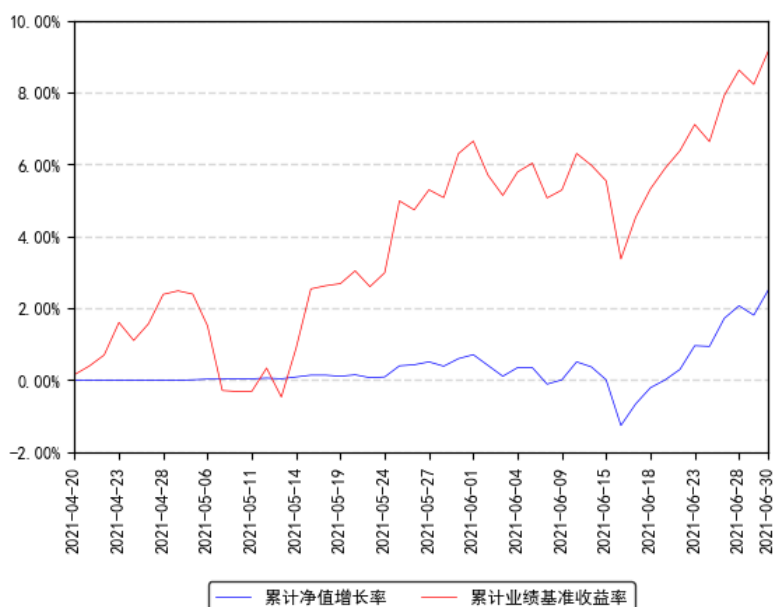
自基金合同生效起至今	2.52%	0.32%	9.17%	0.80%	-6.65%	-0.48%
------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------

南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)C

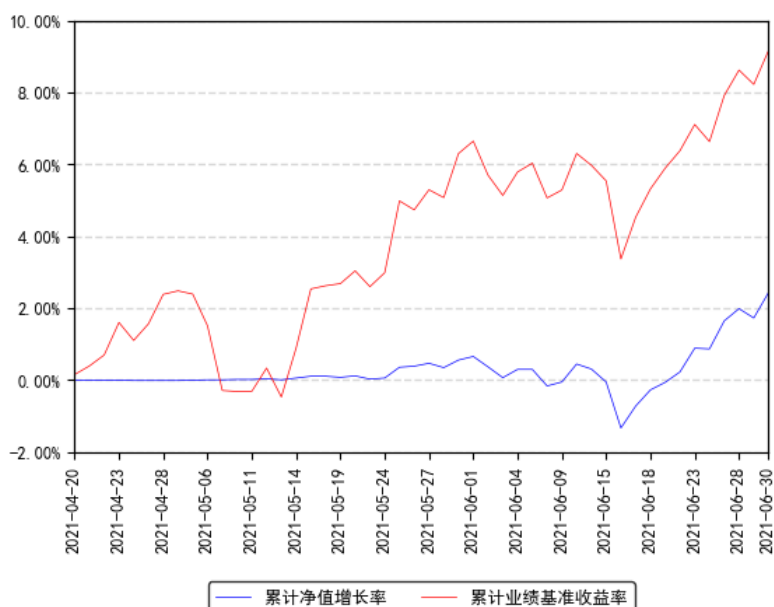
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	2.44%	0.32%	9.17%	0.80%	-6.73%	-0.48%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)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



南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)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4月20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，截至报告期末基金尚未完成建仓。

## § 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		
夏莹莹	本基金基金经理	2021年4月20日	-	15年	女，香港科技大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾先后就职于晨星资讯投资管理部、招商银行私人银行部、腾讯支付基础平台与金融应用线金融合作和政策部，历任投资顾问、高级分析师、金融产品高级经理。2017年3月加入南方基金，任宏观研究与资产配置部高级研究员。2017年11月10日至今，任南方全天候策略基金经理；2019年1月17日至今，任南方合顺多资产基金经理；2021年4月20日至今，任南方浩睿进取京选3个月持有混合（FOF）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。

## 4.2 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，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

回顾二季度，疫苗接种在欧美主要发达国家和中国、日本、韩国等地继续顺利推进，尽管印度和巴西每日新增病例在二季度大幅走高，但由于经济体量在世界经济中占比较小，因此并未影响全球经济复苏进程。美国通胀数据处于高位，但由于3月下旬以来，美国采取第二轮大规模财政刺激政策，市场流动性充裕，叠加经济复苏，风险偏好抬升，全球股票资产在二季度整体表现较好。海外方面，截止6/30/2021，标普500二季度上涨8.56%，纳斯达克指数上涨11.2%。国内方面，二季度流动性整体趋于宽松，一季报显示大部分企业盈利向好，带动市场情绪转好，创业板涨幅领先，沪深300上涨2.54%，上证50下跌2.2%，债市上涨。大宗商品方面，原油受益于海外需求驱动二季度大幅上涨17.1%，黄金和铜价于三月底反弹后于六月初回落。

南方浩睿进取京选3个月持有FOF于4月20日成立，成立以来组合保持了较为平稳的运作。基金配置方面，组合成立初期主要配置于中短期债券、货币基金、混合一级债基和中长期债券型基金，考虑到费用，因此初期配置主要以配置内部基金为主。此外，为后续

可以参与两市新股申购，组合逐步建立沪市打新底仓，股票底仓配置上采取行业配置分散、个股相对集中的策略，结合南方基金权益投研优势，精选个股。行业层面，前五大行业分别为银行、食品饮料、医药、有色和电力设备及新能源，目前组合已经完成参与科创板新股申购的底仓构建。组合于五月初逐步增加对于偏股型基金的配置比例，截止6月末，偏股混合、灵活配置、普通股票型、QDII国际股票和股票指数型基金占比约55%。

对于组合中配置的基金，我们坚持从基金经理投资经验、投资理念，中长期业绩表现，等多维度定量和定性维度出发从全市场精选优秀的管理人构建组合。考虑到市场风格轮动较快，因此组合在配置上采取了均衡配置策略。

#### 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1.0252元，报告期内，份额净值增长率为2.52%，同期业绩基准增长率为9.17%；本基金C份额净值为1.0244元，报告期内，份额净值增长率为2.44%，同期业绩基准增长率为9.17%。

#### 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	80,734,686.73	7.02
	其中：股票	80,734,686.73	7.02
2	基金投资	951,282,620.30	82.70
3	固定收益投资	56,945,000.00	4.95
	其中：债券	56,945,000.00	4.95
	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	59,022,517.34	5.13
8	其他资产	2,338,299.95	0.20
9	合计	1,150,323,124.32	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	6,221,241.00	0.54
C	制造业	35,171,473.49	3.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,716,262.00	0.41
E	建筑业	4,196,014.44	0.37
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,068,090.40	0.53
J	金融业	21,768,475.00	1.89
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	2,593,130.40	0.23
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	80,734,686.73	7.02

### 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	601009	南京银行	473,000	4,975,960.00	0.43
2	601398	工商银行	900,000	4,653,000.00	0.40
3	601668	中国建筑	900,000	4,185,000.00	0.36
4	000975	银泰黄金	370,000	3,518,700.00	0.31
5	601877	正泰电器	101,400	3,384,732.00	0.29
6	600887	伊利股份	91,000	3,351,530.00	0.29
7	600060	海信视像	189,700	3,205,930.00	0.28
8	601077	渝农商行	770,000	3,072,300.00	0.27



9	002948	青岛银行	609,500	3,029,215.00	0.26
10	603613	国联股份	30,000	2,999,100.00	0.26

#### 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	56,000,000.00	4.87
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）	945,000.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	56,945,000.00	4.95

#### 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	019640	20 国债 10	560,000	56,000,000.00	4.87
2	113050	南银转债	9,450	945,000.00	0.08

#### 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

无。

## 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。

## 5.11 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。

**5.11.2 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	97,554.19
2	应收证券清算款	999,987.04
3	应收股利	4.76
4	应收利息	1,162,294.91
5	应收申购款	68,049.90
6	其他应收款	10,409.15
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,338,299.95

### 5.11.4 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。

### 5.11.5 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 基金中基金

### 6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)	是否属于 基金管理 人及管理 人关联方 所管理的 基金
1	006320	易方达安瑞短债债券C	契约型开放式	143,852,799.65	144,327,513.89	12.56	否
2	202103	南方多利增强债券A	契约型开放式	45,034,922.86	50,285,994.87	4.38	是
3	007149	南方初元中短债债券A	契约型开放式	45,241,195.81	48,380,934.80	4.21	是
4	007130	中庚小盘价值股票	契约型开放式	23,665,525.24	42,678,408.22	3.71	否
5	004235	中欧价值智选回报混合C	契约型开放式	8,670,088.69	40,532,664.63	3.53	否
6	070019	嘉实价值优势混合	契约型开放式	15,367,023.21	40,123,297.60	3.49	否
7	005794	银华心怡灵活配置混合	契约型开放式	12,617,672.92	38,010,739.67	3.31	否
8	163415	兴全商业模式优选混合(LOF)	契约型开放式	9,275,172.00	36,674,030.09	3.19	否
9	002846	泓德泓华灵活配置混合	契约型开放式	14,368,607.89	36,457,468.80	3.17	否
10	450009	国富中小盘股票	契约型开放式	12,534,470.75	35,409,879.87	3.08	否

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021-04-20 至 2021-06-30	其中:交易及持有基金管理人 以及管理人关联方所管理基 金产生的费用
当期交易基金产生的申购费 (元)	13,000.00	-
当期交易基金产生的赎回费 (元)	1,000.00	-
当期持有基金产生的应支付 销售服务费(元)	196,607.12	21,600.97
当期持有基金产生的应支付 管理费(元)	999,726.96	243,637.19
当期持有基金产生的应支付 托管费(元)	210,337.71	63,623.59

## 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内,南方浩睿进取京选3个月持有FOF所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

## § 7 开放式基金份额变动

单位:份

项目	南方浩睿进取京选3个月持 有混合(FOF)A	南方浩睿进取京选3个月持 有混合(FOF)C
基金合同生效日(2021年4月 20日)基金份额总额	1,095,694,101.24	23,162,690.31
基金合同生效日起至报告期 期末基金总申购份额	1,304,046.27	947,341.90
减:基金合同生效日起至报 告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期 期末基金拆分变动份额(份 额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	1,096,998,147.51	24,110,032.21

## § 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 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。

## 8.2 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。

## § 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、《南方浩睿进取京选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》；
- 2、《南方浩睿进取京选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)托管协议》；
- 3、南方浩睿进取京选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)2021 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>