南方中小盘成长股票型证券投资基金
2021年中期报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021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 2021 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 2021 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.....11
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.....12
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.....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.....14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....15
6.4 报表附注.....17
§7 投资组合报告.....37
7.1 期末基金资产组合情况.....37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....37
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.....38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....44
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.....44
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.....44
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.....44
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.....45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....45

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 45
7.12 投资组合报告附注 45
§8 基金份额持有人信息 46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
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 46
§9 开放式基金份额变动 46
§10 重大事件揭示 47
10.1 基金份额持有人大会决议 47
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 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
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 48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 48
10.8 其他重大事件 49
§11 影响投资者决策的其他重要信息 51
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 51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 51
§12 备查文件目录 51
12.1 备查文件目录 52
12.2 存放地点 52
12.3 查阅方式 52

§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	126,770,344.12 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	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。 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。

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	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
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		杨小松（代为履行法定代表人职责）	陈四清

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务（包括代为履行公司法定代表人职责以及法定、公司章程和制度规定的公司董事长其他各项职责）。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

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	http://www.nffund.com
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(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	31,620,860.03
本期利润	31,270,420.56
加权平均基金份额本期利润	0.2487
本期加权平均净值利润率	14.75%
本期基金份额净值增长率	15.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	92,801,250.08
期末可供分配基金份额利润	0.7320
期末基金资产净值	232,614,670.68
期末基金份额净值	1.8349
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	106.20%

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；

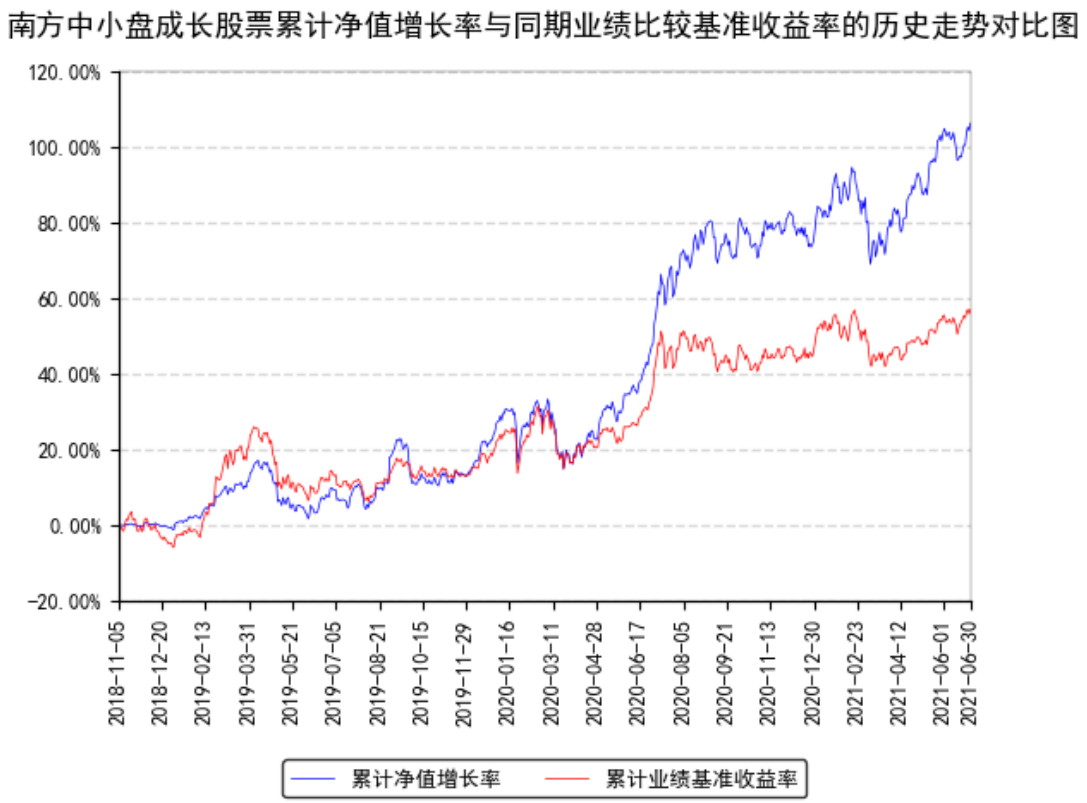
3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	1.49%	0.83%	1.07%	0.71%	0.42%	0.12%
过去三个月	15.29%	0.98%	8.30%	0.68%	6.99%	0.30%
过去六个月	15.45%	1.28%	5.91%	0.94%	9.54%	0.34%
过去一年	42.51%	1.30%	18.54%	1.07%	23.97%	0.23%
自基金合同生效起至今	106.20%	1.18%	56.88%	1.16%	49.32%	0.02%

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



§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。

截至本报告期末，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 1.4 万亿元，旗下管理 245 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	-	12 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；2020 年 11 月 18 日至今，任南方誉鼎一年持有期混合基金经理。
姚万宁	本基金基金经理助理	2018 年 11 月 3 日	-	8 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，两两组合间单日、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，并且交易占优比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合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，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 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，股票市场震荡上行。一方面，得益于对疫情的有效控制，全球经济逐步进入修复阶段，企业的盈利扩张为估值修复奠定良好基础；另一方面，市场经历过去 2 年的持续反弹后分化加剧，部分优质资产的估值处于相对高位。

报告期内上证综指上涨 3.4%，创业板指上涨 17.2%，沪深 300 指数上涨 0.2%。结构方面，新能源、电子、医药等代表新经济发展方向的板块，以及钢铁、化工等受益于全球经济复苏盈利回升的板块大幅跑赢市场，而地产、家电、军工等板块受地产投资增速下行和年初流动性收紧预期影响调整明显。

报告期内，我们保持了相对较高的股票仓位，重点在新能源、医药、消费等领域配置成长性较高的优质公司。随着整体市场波动加大，我们立足基本面和估值水平，动态优化持仓结构，努力使产品保持较高的风险收益性价比。

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1.8349元，报告期内，份额净值增长率为15.45%，同期业绩基准增长率为5.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们对权益市场依旧充满信心。如果把全世界两百多个国家看成两百多个上市公司，那么中国是当之无愧的核心资产。那些有护城河的公司，不光是在顺境中能大展拳脚，在逆境中一样经得起考验。改革开放以来，中国不论遭遇逆境顺境，都保持了快速的增长，我们的体制展现出了旺盛的生命力。如果把新冠疫情当作一次压力测试，中国无疑交出了一份最好的答卷，一枝独秀。作为世界上人口最多的国家，我们快速高效地控制住了疫情，给全球输出了宝贵的经验，提供了有效的帮助。我们保持了产业链的完整，这使得产业链上的龙头公司国际竞争力不断增强，全球市场份额不断提升。所以，A 股中的优质公司，自然是优中选优，不光是我们的居民财产会加大配置，也会源源不断的吸引外资来配置。

此外，中国庞大的经济体量，以及经济转型的过程中，会带来源源不断的投资机会。这几年我们也很欣喜地看到了许多新的商业模式和优质公司涌现出来，涵盖了直播，医美，电动车，潮玩，电子烟等赛道。在生活中正遍地开花的剧本杀、密室、vr 游戏，将来都有可能形成新的投资机会。

不可否认的是，经历了过去两年多来的大幅上涨，不少优质公司的估值已经并不便宜，这也意味着后续市场的波动将会继续加大，类似今年 2 月份以来的调整难免再次发生。因此，我们在保持对高景气赛道关注度的同时，也将密切关注过去一段时间因景气度不佳表现低迷的优质公司可能出现的拐点性机会，主要包括消费、金融等方向。

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2021年1月18日已分配数（A类每10份基金份额派发红利1.21元）为2020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。

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 2021 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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	11,512,573.86	9,740,357.57
结算备付金		646,616.83	693,465.38
存出保证金		75,591.98	63,135.81
交易性金融资产	6.4.3.2	221,460,166.91	216,865,259.52
其中：股票投资		209,136,452.61	204,605,247.02
基金投资		-	-
债券投资		12,323,714.30	12,260,012.50
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		1,997,934.08	1,560,893.29
应收利息	6.4.3.5	170,562.49	103,483.01
应收股利		-	-
应收申购款		408,512.20	332,062.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		236,271,958.35	229,358,657.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		3,126.54	1,293,083.55
应付赎回款		2,805,204.93	1,233,833.26
应付管理人报酬		281,539.50	289,705.59
应付托管费		46,923.26	48,284.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	429,593.35	529,458.46
应交税费		1.12	9.01
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	90,898.97	171,910.78
负债合计		3,657,287.67	3,566,284.92
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	126,770,344.12	132,169,533.52
未分配利润	6.4.3.10	105,844,326.56	93,622,838.90
所有者权益合计		232,614,670.68	225,792,372.42

负债和所有者权益总计		236,271,958.35	229,358,657.34

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.8349 元，基金份额总额 126,770,344.12 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		34,722,244.42	25,359,295.06
1.利息收入		134,381.15	150,416.96
其中：存款利息收入	6.4.3.11	29,180.52	29,935.01
债券利息收入		105,200.63	120,481.95
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		34,610,247.43	18,338,003.52
其中：股票投资收益	6.4.3.12	32,931,897.34	16,917,375.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	104,025.93	286,233.54
资产支持证券投资收益	6.4.3.14	-	-
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	1,574,324.16	1,134,394.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	-350,439.47	6,701,245.12

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	328,055.31	169,629.46
减：二、费用		3,451,823.86	2,324,720.38
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	1,580,041.78	1,170,898.21
2.托管费	6.4.6.2.2	263,340.31	195,149.70
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4.交易费用	6.4.3.20	1,504,954.88	850,064.13
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		0.12	0.74
7.其他费用	6.4.3.21	103,486.77	108,607.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,270,420.56	23,034,574.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,270,420.56	23,034,574.68

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	132,169,533.52	93,622,838.90	225,792,372.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,270,420.56	31,270,420.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变	-5,399,189.40	-4,355,021.70	-9,754,211.10

动数（净值减少以“－”号填列）			
其中：1.基金申购款	63,410,925.12	43,784,167.71	107,195,092.83
2.基金赎回款	-68,810,114.52	-48,139,189.41	-116,949,303.93
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）	-	-14,693,911.20	-14,693,911.20
五、期末所有者权益（基金净值）	126,770,344.12	105,844,326.56	232,614,670.68
项目	上年度可比期间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“－”号填列）	-	-7,097,892.52	-7,097,892.52
五、期末所有者权益（基金净值）	114,603,731.25	49,999,295.48	164,603,026.73

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	11,512,573.86
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	11,512,573.86

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		203,047,726.99	209,136,452.61	6,088,725.62
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	12,320,427.85	12,323,714.30	3,286.45
	银行间市场	-	-	-
	合计	12,320,427.85	12,323,714.30	3,286.45
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		215,368,154.84	221,460,166.91	6,092,012.07

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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	620.94
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	261.90
应收债券利息	169,649.05
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	30.60
合计	170,562.49

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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	429,593.35
银行间市场应付交易费用	-
合计	429,593.35

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,596.41
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,302.56
合计	90,898.97

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	132,169,533.52	132,169,533.52
本期申购	63,410,925.12	63,410,925.12
本期赎回（以“-”号填列）	-68,810,114.52	-68,810,114.52
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	126,770,344.12	126,770,344.12

注：申购含红利再投、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	79,320,918.27	14,301,920.63	93,622,838.90
本期利润	31,620,860.03	-350,439.47	31,270,420.56
本期基金份额交易产生的变动数	-3,446,617.02	-908,404.68	-4,355,021.70
其中：基金申购款	38,506,660.33	5,277,507.38	43,784,167.71
基金赎回款	-41,953,277.35	-6,185,912.06	-48,139,189.41
本期已分配利润	-14,693,911.20	-	-14,693,911.20
本期末	92,801,250.08	13,043,076.48	105,844,326.56

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	22,140.50
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	6,320.20
其他	719.82
合计	29,180.52

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	510,851,577.46
减：卖出股票成本总额	477,919,680.12
买卖股票差价收入	32,931,897.34

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,371,168.12
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,169,885.00
减：应收利息总额	97,257.19
买卖债券差价收入	104,025.93

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,574,324.16
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	1,574,324.16

6.4.3.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-350,439.47
——股票投资	-312,539.27
——债券投资	-37,900.20
——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	-350,439.47

6.4.3.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	300,135.90
基金转换费收入	27,919.41
合计	328,055.31

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,504,954.88
银行间市场交易费用	-
合计	1,504,954.88

6.4.3.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	584.21
合计	103,486.77

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

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2021 年 7 月 8 日宣告 2021 年度第 1 次分红，向截至 2021 年 7 月 12 日止在本基金注册登记人南方基金管理股份有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 1.4700 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(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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%

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,580,041.78	1,170,898.21
其中：支付销售机构的客户维护费	550,935.76	229,141.33

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：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	263,340.31	195,149.70

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：

日托管费＝前一日基金资产净值 × 0.25% / 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	11,512,573.86	22,140.50	11,946,287.55	26,322.07

注：本基金由基金托管人中国工商银行保管的银行存款，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

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券	113050	南银转债	优先配售	11,060	1,106,000.00
兴业证券	605086	龙高股份	网下申购	443	5,696.98
华泰联合证券	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
兴业证券	605298	必得科技	网下申购	391	6,252.09
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证券	688083	中望软件	网下申购	519	78,109.50
华泰联合证券	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证券	688161	威高骨科	网下申购	1,547	56,032.34
兴业证券	688195	腾景科技	网下申购	2,693	36,624.80

华泰联合证券	688260	昀冢科技	网下申购	2,990	28,793.70
华泰联合证券	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证券	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
兴业证券	688597	煜邦电力	网下申购	3,907	22,973.16
华泰联合证券	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证券	688633	星球石墨	网下申购	1,402	47,135.24
兴业证券	688639	华恒生物	网下申购	2,302	53,314.32
兴业证券	300941	创识科技	网下申购	3,219	68,596.89
华泰联合证券	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16

上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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	2021 年 1 月 18 日	-	2021 年 1 月 18 日	1.2100	11,863,623.20	2,830,288.00	14,693,911.20	-
合计	-	-	-	1.2100	11,863,623.20	2,830,288.00	14,693,911.20	-

6.4.8 期末（2021 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
000526	学大教育	2021年3月17日	2021年9月22日	非公开发行锁定期	38.53	25.07	51,908	2,000,015.24	1,301,333.56	-
002294	信 立 泰	2021年6月22日	2021年12月24日	非公开发行锁定期	28.37	30.82	105,746	3,000,014.02	3,259,091.72	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	创业板新股锁定期	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300762	上海瀚讯	2021年6月3日	2021年11月15日	锁定期转增	-	26.66	34,798	-	927,714.68	-
300762	上海瀚讯	2021年4月29日	2021年11月15日	非公开发行锁定期	32.50	26.66	57,997	1,884,902.50	1,546,200.02	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	创业板新股锁定期	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	创业板新股锁定期	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药 易 购	2021年1月20日	2021年7月27日	创业板新股锁定期	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	创业板新股锁定期	21.31	49.94	322	6,861.82	16,080.68	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	创业板新股锁定期	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板新股锁定期	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼 卡 龙	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板新股锁定期	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年6月4日	2021年8月25日	锁定期转增	-	27.42	108	-	2,961.36	-
300948	冠中生态	2021年2月18	2021年8月25	创业板新股锁	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-

		日	日	定期						
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	创业板新股锁定期	28.77	99.85	233	6,703.41	23,265.05	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	创业板新股锁定期	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	创业板新股锁定期	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	创业板新股锁定期	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	创业板新股锁定期	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	创业板新股锁定期	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	创业板新股锁定期	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	创业板新股锁定期	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	创业板新股锁定期	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业板新股锁定期	48.59	90.39	176	8,551.84	15,908.64	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业板新股锁定期	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	创业板新股锁定期	24.90	24.81	224	5,577.60	5,557.44	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	创业板新股锁定期	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	创业板新股锁定期	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021 年	2021 年	创业板	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-

		5 月 17 日	11 月 24 日	新股锁定期						
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	创业板新股锁定期	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	创业板新股锁定期	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢 乐 家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	创业板新股锁定期	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	创业板新股锁定期	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	创业板新股锁定期	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德 迈 仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	创业板新股锁定期	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	创业板新股锁定期	12.54	27.89	697	8,740.38	19,439.33	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	创业板新股锁定期	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	创业板新股锁定期	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	创业板新股锁定期	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利 和 兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	创业板新股锁定期	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	创业板新股锁定期	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-

605162	新 中 港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未上市	21.96	21.96	2,444	53,670.24	53,670.24	-
688161	威高骨科	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	科创板新股锁定期	36.22	82.27	1,547	56,032.34	127,271.69	-
688200	华峰测控	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 15 日	询价转让	260.10	427.99	4,000	1,040,400.00	1,711,960.00	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688269	凯立新材	2021 年 6 月 1 日	2021 年 12 月 9 日	科创板新股锁定期	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-
688359	三孚新科	2021 年 5 月 14 日	2021 年 11 月 22 日	科创板新股锁定期	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-
688383	新 益 昌	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 28 日	科创板新股锁定期	19.58	106.24	2,701	52,885.58	286,954.24	-
688468	科美诊断	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	科创板新股锁定期	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	-
688533	上声电子	2021 年 4 月 9 日	2021 年 10 月 19 日	科创板新股锁定期	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688597	煜邦电力	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	科创板新股锁定期	5.88	10.16	3,907	22,973.16	39,695.12	-
688667	菱电电控	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	科创板新股锁定期	75.42	103.88	692	52,190.64	71,884.96	-
688676	金盘科技	2021 年 3 月 2	2021 年 9 月 9	科创板新股锁	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-

		日	日	定期						
688685	迈 信 林	2021 年 4 月 30 日	2021 年 11 月 15 日	科创板新股锁定期	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 7 月 2 日	创业板新股锁定期	24.60	163.00	278	6,838.80	45,314.00	-
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
127038	国微转债	2021 年 6 月 10 日	2021 年 7 月 14 日	配债未上市	100.00	100.00	205	20,500.00	20,500.00	-
113050	南银转债	2021 年 6 月 16 日	2021 年 7 月 1 日	配债未上市	100.00	100.00	11,060	1,106,000.00	1,106,000.00	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、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。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

3、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

4、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。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

无。

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合规与风险管理委员会，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》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时间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“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，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，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度管理并进行动态调整等措施严格管理逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，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。

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未来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、存出保证金和债券投资等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	11,512,573.86	-	-	-	11,512,573.86
结算备付金	646,616.83	-	-	-	646,616.83
存出保证金	75,591.98	-	-	-	75,591.98
交易性金融资产	11,197,214.30	-	1,126,500.00	209,136,452.61	221,460,166.91
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	170,562.49	170,562.49
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	11,122.99	-	-	397,389.21	408,512.20
应收证券清算款	-	-	-	1,997,934.08	1,997,934.08
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	23,443,119.96	-	1,126,500.00	211,702,338.39	236,271,958.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,805,204.93	2,805,204.93
应付管理人报酬	-	-	-	281,539.50	281,539.50
应付托管费	-	-	-	46,923.26	46,923.26
应付证券清算款	-	-	-	3,126.54	3,126.54
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	429,593.35	429,593.35
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.12	1.12
其他负债	-	-	-	90,898.97	90,898.97
负债总计	-	-	-	3,657,287.67	3,657,287.67
利率敏感度缺口	23,443,119.96	-	1,126,500.00	208,045,050.72	232,614,670.68
上年度末 2020 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	9,740,357.57	-	-	-	9,740,357.57
结算备付金	693,465.38	-	-	-	693,465.38
存出保证金	63,135.81	-	-	-	63,135.81
交易性金融资产	12,011,512.50	-	248,500.00	204,605,247.02	216,865,259.52
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	103,483.01	103,483.01
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	2,809.00	-	-	329,253.76	332,062.76
应收证券清算款	-	-	-	1,560,893.29	1,560,893.29
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,511,280.26	-	248,500.00	206,598,877.08	229,358,657.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,233,833.26	1,233,833.26
应付管理人报酬	-	-	-	289,705.59	289,705.59
应付托管费	-	-	-	48,284.27	48,284.27
应付证券清算款	-	-	-	1,293,083.55	1,293,083.55
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	529,458.46	529,458.46
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	9.01	9.01
其他负债	-	-	-	171,910.78	171,910.78
负债总计	-	-	-	3,566,284.92	3,566,284.92
利率敏感度缺口	22,511,280.26	-	248,500.00	203,032,592.16	225,792,372.42

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

假设	除市场利率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（ 2021 年 6 月	上年度末（ 2020 年 12

		30 日 ）	月 31 日 ）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-25,589.27	-14,178.70
	2.市场利率平行下降 25 个基点	25,901.25	14,275.11

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(含存托凭证)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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	209,136,452.61	89.91	204,605,247.02	90.62
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	209,136,452.61	89.91	204,605,247.02	90.62

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（ 2021 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2020 年 12 月 31 日 ）
	1.沪深 300 上升 5%	10,386,720.16	9,760,828.34
	2.沪深 300 下降 5%	-10,386,720.16	-9,760,828.34

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	209,136,452.61	88.52
	其中：股票	209,136,452.61	88.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,323,714.30	5.22
	其中：债券	12,323,714.30	5.22
	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	12,159,190.69	5.15
8	其他资产	2,652,600.75	1.12
9	合计	236,271,958.35	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	3,353,614.80	1.44
B	采矿业	13,664,756.00	5.87
C	制造业	130,429,327.77	56.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	1,485,515.90	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	2,132,159.00	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,642,960.70	5.01
J	金融业	16,002,578.10	6.88
K	房地产业	4,211,592.00	1.81
L	租赁和商务服务业	4,849,933.00	2.08
M	科学研究和技术服务业	3,626,624.40	1.56
N	水利、环境和公共设施管理业	1,117,635.68	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,436,291.56	1.48
Q	卫生和社会工作	8,586,531.94	3.69
R	文化、体育和娱乐业	4,558,540.00	1.96
S	综合	-	-
	合计	209,136,452.61	89.91

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	600741	华域汽车	261,100	6,859,097.00	2.95
2	600346	恒力石化	214,600	5,631,104.00	2.42
3	000860	顺鑫农业	131,682	5,554,346.76	2.39
4	603517	绝味食品	62,300	5,251,267.00	2.26
5	600570	恒生电子	56,068	5,228,341.00	2.25
6	002597	金禾实业	146,419	5,080,739.30	2.18
7	300601	康泰生物	32,500	4,842,500.00	2.08
8	600176	中国巨石	306,820	4,758,778.20	2.05
9	603323	苏农银行	1,063,600	4,658,568.00	2.00
10	601009	南京银行	437,400	4,601,448.00	1.98
11	600690	海尔智家	175,300	4,542,023.00	1.95
12	000975	银泰黄金	476,700	4,533,417.00	1.95

13	600048	保利地产	349,800	4,211,592.00	1.81
14	600519	贵州茅台	2,000	4,113,400.00	1.77
15	000858	五 粮 液	13,800	4,110,882.00	1.77
16	300015	爱尔眼科	55,753	3,957,347.94	1.70
17	603259	药明康德	23,160	3,626,624.40	1.56
18	603993	洛阳钼业	674,400	3,479,904.00	1.50
19	002714	牧原股份	55,140	3,353,614.80	1.44
20	601966	玲珑轮胎	75,600	3,306,744.00	1.42
21	601899	紫金矿业	338,600	3,281,034.00	1.41
22	002294	信 立 泰	105,746	3,259,091.72	1.40
23	600438	通威股份	63,900	2,764,953.00	1.19
24	300496	中科创达	16,600	2,607,196.00	1.12
25	002127	南极电商	253,600	2,477,672.00	1.07
26	300762	上海瀚讯	92,795	2,473,914.70	1.06
27	603799	华友钴业	21,200	2,421,040.00	1.04
28	300618	寒锐钴业	30,500	2,404,620.00	1.03
29	603806	福 斯 特	22,860	2,403,271.80	1.03
30	000100	TCL 科技	311,700	2,384,505.00	1.03
31	002027	分众传媒	252,100	2,372,261.00	1.02
32	000923	河钢资源	124,300	2,370,401.00	1.02
33	002460	赣锋锂业	19,500	2,361,255.00	1.02
34	300122	智飞生物	12,600	2,352,798.00	1.01
35	688526	科前生物	64,788	2,346,621.36	1.01
36	300347	泰格医药	12,100	2,338,930.00	1.01
37	300014	亿纬锂能	22,400	2,328,032.00	1.00
38	601877	正泰电器	69,100	2,306,558.00	0.99
39	600872	中炬高新	54,800	2,302,696.00	0.99
40	300144	宋城演艺	137,000	2,301,600.00	0.99
41	002044	美年健康	251,400	2,290,254.00	0.98
42	601128	常熟银行	368,400	2,284,080.00	0.98
43	603317	天味食品	77,500	2,280,825.00	0.98
44	002948	青岛银行	457,000	2,271,290.00	0.98
45	300413	芒果超媒	32,900	2,256,940.00	0.97
46	300760	迈瑞医疗	4,700	2,256,235.00	0.97
47	300357	我武生物	34,685	2,224,002.20	0.96
48	600887	伊利股份	60,200	2,217,166.00	0.95
49	603866	桃李面包	70,140	2,188,368.00	0.94
50	000661	长春高新	5,600	2,167,200.00	0.93
51	601601	中国太保	74,300	2,152,471.00	0.93
52	002607	中公教育	102,200	2,134,958.00	0.92
53	600009	上海机场	44,300	2,132,159.00	0.92
54	600066	宇通客车	169,500	2,117,055.00	0.91
55	688200	华峰测控	4,000	1,711,960.00	0.74

56	002850	科 达 利	15,600	1,363,440.00	0.59
57	603906	龙蟠科技	38,741	1,355,935.00	0.58
58	605499	东鹏饮料	5,232	1,312,185.60	0.56
59	000526	学大教育	51,908	1,301,333.56	0.56
60	600699	均胜电子	50,500	1,288,760.00	0.55
61	002568	百润股份	13,580	1,287,248.20	0.55
62	002049	紫光国微	8,300	1,279,777.00	0.55
63	000596	古井贡酒	5,300	1,269,350.00	0.55
64	002008	大族激光	30,500	1,231,895.00	0.53
65	688519	南亚新材	32,325	1,220,592.00	0.52
66	300408	三环集团	28,600	1,213,212.00	0.52
67	300558	贝达药业	11,200	1,212,288.00	0.52
68	002847	盐津铺子	12,100	1,206,612.00	0.52
69	603939	益丰药房	21,500	1,205,935.00	0.52
70	600549	厦门钨业	56,100	1,168,563.00	0.50
71	688169	石头科技	926	1,167,686.00	0.50
72	300454	深 信 服	4,500	1,167,660.00	0.50
73	600183	生益科技	49,800	1,165,818.00	0.50
74	603486	科 沃 斯	5,100	1,163,208.00	0.50
75	000338	潍柴动力	64,900	1,159,763.00	0.50
76	688023	安恒信息	4,569	1,151,388.00	0.49
77	002624	完美世界	48,100	1,150,071.00	0.49
78	002384	东山精密	54,200	1,129,528.00	0.49
79	603129	春风动力	9,100	1,129,128.00	0.49
80	300572	安车检测	34,600	1,122,424.00	0.48
81	002078	太阳纸业	83,900	1,120,065.00	0.48
82	600323	瀚蓝环境	49,500	1,078,605.00	0.46
83	688383	新 益 昌	2,701	286,954.24	0.12
84	688083	中望软件	519	286,643.70	0.12
85	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.11
86	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.08
87	688161	威高骨科	1,547	127,271.69	0.05
88	688667	菱电电控	692	71,884.96	0.03
89	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.03
90	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.03
91	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.03
92	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.03
93	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
94	688087	英科再生	2,444	53,670.24	0.02
95	688685	迈 信 林	2,612	50,934.00	0.02
96	300919	中伟股份	278	45,314.00	0.02
97	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
98	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.02

99	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
100	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
101	300953	震裕科技	233	23,265.05	0.01
102	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
103	300941	创识科技	419	21,066.48	0.01
104	301009	可靠股份	697	19,439.33	0.01
105	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
106	300981	中红医疗	176	15,908.64	0.01
107	300955	嘉亨家化	314	14,830.88	0.01
108	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
109	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
110	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
111	300937	药 易 购	244	13,105.24	0.01
112	301013	利 和 兴	471	12,768.81	0.01
113	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
114	300966	共同药业	358	12,311.56	0.01
115	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
116	300997	欢 乐 家	928	12,110.40	0.01
117	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
118	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
119	300962	中金辐照	657	11,373.12	0.00
120	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
121	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
122	301011	华立科技	250	9,424.50	0.00
123	300945	曼 卡 龙	474	8,949.12	0.00
124	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
125	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
126	605162	新 中 港	1,377	8,358.39	0.00
127	300987	川网传媒	304	8,186.69	0.00
128	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
129	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
130	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
131	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
132	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
133	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
134	300985	致远新能	224	5,557.44	0.00
135	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
136	301010	晶雪节能	272	5,127.96	0.00
137	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
138	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
139	301007	德 迈 仕	303	4,375.32	0.00
140	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
141	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00

142	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

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。

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	600741	华域汽车	12,648,798.14	5.60
2	300601	康泰生物	11,935,617.48	5.29
3	600346	恒力石化	8,541,233.00	3.78
4	601009	南京银行	7,485,482.00	3.32
5	688526	科前生物	7,084,079.35	3.14
6	600690	海尔智家	7,082,292.00	3.14
7	000860	顺鑫农业	7,068,910.00	3.13
8	002459	晶澳科技	6,978,462.00	3.09
9	600570	恒生电子	6,801,278.60	3.01
10	002714	牧原股份	6,586,247.50	2.92
11	300724	捷佳伟创	6,558,111.00	2.90
12	601899	紫金矿业	6,303,618.50	2.79
13	300357	我武生物	6,251,579.10	2.77
14	600887	伊利股份	6,206,074.00	2.75
15	688122	西部超导	6,181,028.32	2.74
16	600048	保利地产	6,022,223.87	2.67
17	000895	双汇发展	5,875,163.00	2.60
18	601601	中国太保	5,776,395.00	2.56
19	600872	中炬高新	5,685,207.00	2.52
20	600276	恒瑞医药	5,546,926.28	2.46
21	603129	春风动力	5,487,013.40	2.43
22	002607	中公教育	5,393,629.50	2.39
23	300496	中科创达	5,237,091.00	2.32
24	002294	信 立 泰	5,143,628.02	2.28
25	603799	华友钴业	5,115,746.00	2.27
26	600009	上海机场	5,045,974.00	2.23
27	000923	河钢资源	4,995,307.00	2.21
28	601100	恒立液压	4,961,317.00	2.20
29	603517	绝味食品	4,948,487.00	2.19
30	600809	山西汾酒	4,911,082.00	2.18
31	000975	银泰黄金	4,699,822.00	2.08
32	603323	苏农银行	4,649,218.00	2.06

33	000858	五 粮 液	4,641,540.00	2.06

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	600779	水 井 坊	9,135,246.00	4.05
2	002459	晶澳科技	9,087,060.37	4.02
3	300601	康泰生物	8,398,235.00	3.72
4	603658	安图生物	7,155,483.82	3.17
5	688526	科前生物	6,749,838.75	2.99
6	002979	雷赛智能	6,720,572.40	2.98
7	300558	贝达药业	6,637,422.00	2.94
8	688122	西部超导	6,534,024.30	2.89
9	300724	捷佳伟创	6,532,880.00	2.89
10	688608	恒玄科技	5,746,372.30	2.54
11	300357	我武生物	5,705,702.00	2.53
12	603517	绝味食品	5,676,008.97	2.51
13	601128	常熟银行	5,541,983.00	2.45
14	600276	恒瑞医药	5,520,433.80	2.44
15	600809	山西汾酒	5,400,611.89	2.39
16	601799	星宇股份	5,355,416.88	2.37
17	000671	阳 光 城	5,220,782.35	2.31
18	600741	华域汽车	5,120,403.44	2.27
19	603939	益丰药房	5,079,652.00	2.25
20	002049	紫光国微	5,042,425.00	2.23
21	002847	盐津铺子	5,038,958.00	2.23
22	601100	恒立液压	4,967,987.49	2.20
23	000830	鲁西化工	4,723,525.00	2.09
24	000895	双汇发展	4,669,686.00	2.07
25	000998	隆平高科	4,662,915.00	2.07
26	603353	和顺石油	4,653,280.00	2.06
27	600872	中炬高新	4,648,680.38	2.06
28	688561	奇 安 信	4,629,258.99	2.05
29	600399	抚顺特钢	4,579,207.50	2.03
30	603129	春风动力	4,558,522.00	2.02

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	482,763,424.98
卖出股票收入（成交）总额	510,851,577.46

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	10,742,991.20	4.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	454,223.10	0.20
	其中：政策性金融债	454,223.10	0.20
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）	1,126,500.00	0.48
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,323,714.30	5.30

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	019649	21 国债 01	55,000	5,503,850.00	2.37
2	019640	20 国债 10	43,800	4,380,000.00	1.88
3	113050	南银转债	11,060	1,106,000.00	0.48
4	019654	21 国债 06	5,140	514,154.20	0.22
5	108604	国开 1805	4,530	454,223.10	0.20

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	75,591.98
2	应收证券清算款	1,997,934.08

3	应收股利	-
4	应收利息	170,562.49
5	应收申购款	408,512.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,652,600.75

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
28,382	4,466.58	166,857.77	0.13%	126,603,486.35	99.87%

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	603,131.62	0.4758%

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、基金投资和研究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	50~100

§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	132,169,533.52
本报告期基金总申购份额	63,410,925.12
减：报告期基金总赎回份额	68,810,114.52
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	126,770,344.12

§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

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长病逝缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

2021 年 5 月 19 日，公司副总经理常克川兼任首席信息官。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”） 根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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	
国信证券	1	355,817,029.83	36.27%	324,246.74	36.27%	-
方正证券	1	271,196,049.88	27.65%	247,136.79	27.65%	-
安信证券	1	145,700,104.85	14.85%	132,762.22	14.85%	-
中金公司	1	70,560,921.99	7.19%	64,302.41	7.19%	-
华创证券	1	58,843,814.55	6.00%	53,624.34	6.00%	-
海通证券	1	56,272,010.83	5.74%	51,282.13	5.74%	-
瑞银证券	1	22,511,533.03	2.29%	20,514.85	2.30%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

注：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
国信证券	273,968.12	3.25%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	8,144,987.00	96.75%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

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	2021-01-13
2	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	2021-01-14
3	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	2021-01-19
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-25
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资	证券时报、基金管理	2021-02-04

	关联方承销证券的关联交易公告	人网站、中国证监会基金电子披露网站	
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-23
7	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-02
8	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-08
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-16
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-19
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金获配紫光学大（000526）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-19
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
13	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-29
14	南方基金管理股份有限公司关于中信建投期货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	2021-04-02
15	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金申购费率优惠标准的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-08
16	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-13
17	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方兴业证券承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
18	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方华泰联合证券承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
19	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金获配上海瀚讯（300762）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-01

20	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-01
21	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-13
22	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-15
23	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-21
24	南方基金管理股份有限公司关于北京加和基金销售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	2021-06-08
25	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-11
26	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-18
27	南方基金管理股份有限公司关于大河财富基金销售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	2021-06-18
28	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金获配信立泰（002294）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-24
29	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-25

§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 2021 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