

# 南方香港成长灵活配置混合型证券投资 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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	36
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....	37
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	45
7.7 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.....	45
7.8 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.....	46

7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	46
7.10	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	46
7.11	投资组合报告附注	46
§8	基金份额持有人信息	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2	期末上市基金前十名持有人	47
	无。	47
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.4	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	47
§9	开放式基金份额变动	47
§10	重大事件揭示	47
10.1	基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4	基金投资策略的改变	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	51
§11	影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	52
§12	备查文件目录	52
12.1	备查文件目录	52
12.2	存放地点	52
12.3	查阅方式	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	南方香港成长灵活配置混合
基金主代码	001691
交易代码	001691
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,320,572,379.01 份
基金合同存续期	不定期

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“南方香港成长”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，通过定量与定性相结合的方法分析对宏观经济中结构性、政策性、周期性以及突发性事件进行研判，挖掘未来经济的发展趋势及背后的驱动因素，预测可能对资本市场产生的重大影响，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自上而下”的行业配置策略和“自下而上”的个股选择策略，精选出具有持续竞争优势，且估值有吸引力的股票，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获取超额收益。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+人民币同期活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

### 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.com
客户服务电话	400-889-8899	95566

传真	0755-82763889	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街 1 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	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518017	100818
法定代表人	杨小松（代为履行法定代表人职责）	刘连舸

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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问	境外资产托管人
名称	中文	- 中国银行（香港）有限公司
	英文	- BANK OF CHINA (HONG KONG) LIMITED
注册地址	-	1 Garden Road, Hong Kong
办公地址	-	1 Garden Road, Hong Kong
邮政编码	-	999077

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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）

## 2.6 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	-102,996,459.95
本期利润	-83,142,530.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0662
本期加权平均净值利润率	-2.60%
本期基金份额净值增长率	9.95%
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	-27,885,916.69
期末可供分配基金份额利润	-0.0211
期末基金资产净值	3,312,595,971.97
期末基金份额净值	2.508
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	150.80%

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。

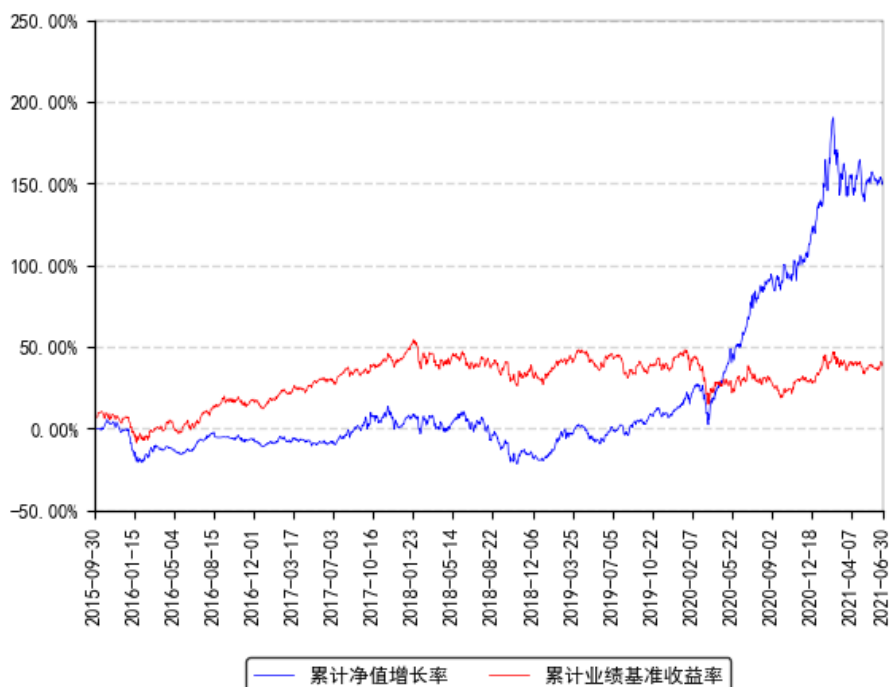
## 3.2 基金净值表现

### 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	-0.99%	0.73%	0.28%	0.74%	-1.27%	-0.01%
过去三个月	1.29%	1.18%	0.02%	0.83%	1.27%	0.35%
过去六个月	9.95%	1.76%	4.47%	1.13%	5.48%	0.63%
过去一年	55.01%	1.63%	7.22%	1.10%	47.79%	0.53%
过去三年	141.85%	1.53%	-1.33%	1.20%	143.18%	0.33%
自基金合同生效起至今	150.80%	1.73%	38.61%	1.11%	112.19%	0.62%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方香港成长灵活配置混合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		
黄亮	本基金基金经理	2019 年 4 月 3 日	-	20 年	北京大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾任职于招商证券股份有限公司、天华投资有限责任公司，2005 年加入南方基金国际业务部，现任国际业务部总经理、国际投资决策委员会委员；2011 年 9 月 26 日至 2015 年 5 月 13 日，任南方中国中小盘基金经理；2015 年 5 月 13 日至 2017 年 11 月 9 日，任南方香港优选基金经理；2017 年 4 月 26 日至 2019 年 4 月 22 日，任国企精明基金经理；2010 年 12 月 9 日至 2020 年 9 月 18 日，任南方金砖基金经理；2009 年 6 月 25 日至今，任南方全球基金经理；2016 年 6 月 15 日至今，任南方原油基金经理；2017 年 10 月 26 日至今，任美国 REIT 基金经理；2019 年 4 月 3 日至今，任南方香港成长基金经理；2020 年 12 月 25 日至今，任南方沪港深优势基金经理；2021 年 4 月 2 日至今，兼任投资经理。
王士聪	本基金基金经理	2020 年 5 月 15 日	-	4 年	美国布兰迪斯大学国际经济与金融学硕士，注册金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2016 年 7 月加入南方基金，任国际业务部研究员。2018 年 11 月 30 日至 2020 年 5 月 15 日，任南方全球基金经理助理；2019 年 4 月 10 日至 2020 年 5 月 15 日，任南方香港成长基金经理助理；2020 年 5 月 15 日至今，任南方香港成长基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
黄亮	公募基金	5	7,648,090,433.80	2009 年 6 月 25 日
	私募资产管理计划	1	101,579,511.56	2021 年 4 月 8 日
	其他组合	1	311,924,174.35	2021 年 2 月 5 日
	合计	7	8,061,594,119.71	-

## 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

## 4.3 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。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 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。

### 4.4.2 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。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年全球尽管部分地区通报新增确诊出现回升迹象，但随着疫苗的普及，全球整体新增确诊进一步下降，停工停产以及社交隔离逐步减少，新冠疫情对于经济带来

的短期扰动正在逐步消退。与此同时，随着信贷政策的逐步正常化以及对于房地产行业的严格调控，中国整体经济动能呈现从高位回落的趋势。根据 Bloomberg 的统计，2021 年 4 月至 2021 年 6 月发达市场 Markit 制造业月度 PMI 分别为 59.3、59.8 和 59.5，延续高景气，其中美国 Markit 制造业月度 PMI 分别为 60.5、62.1 和 62.1；新兴市场 Markit 制造业月度 PMI 分别为 52.2、52.0 和 51.3，保持在荣枯线以上但呈现回落的趋势。从风格上来看，全球成长股指数跑赢价值股指数。按美元计价全收益口径计算，2021 年第二季度 MSCI 全球价值指数上涨 4.9%，MSCI 全球成长指数上涨 10.9%。

报告期间，MSCI 全球指数按美元计价上涨 7.31%，MSCI 新兴市场指数按美元计价上涨 4.42%，恒生指数按港币计价上涨 1.58%，黄金价格按美元计价上涨 3.65%，十年期美国国债、十年期日本国债及十年期德国国债收益率分别下降 27 个基点、4 个基点和回升 9 个基点。新兴市场方面，巴西圣保罗证交所指数按本币计价上涨 8.72%，印度 Nifty 指数按本币计价上涨 7.02%，俄罗斯 MOEX 指数按本币计价上涨 8.47%。美元指数小幅下行，由 93.23 下跌至 92.44。

港股市场方面，2021 年第二季度恒生指数小幅上涨 1.58%，恒生国企指数下跌 2.81%。从市值角度来看，恒生大型股指数上涨 0.17%，恒生中型股指数上涨 5.53%，恒生小型股指数上涨 7.44%。根据 Wind 统计，2021 年二季度港股通南下资金累计净买入 771 亿元人民币，较 2021 年一季度的 3115 亿元人民币明显回落。恒生 AH 股溢价指数于报告期内小幅回升，由 134.37 点提高至 138.89 点。恒生行业方面，工业、消费品制造及服务业、能源板块分别跑赢恒生指数 10.49%、7.16% 和 4.05%，而地产建筑、电讯和金融板块分别落后恒生指数 5.94%、5.87% 和 5.77%。

在上半年，反垄断、数据、教育等领域的监管措施进一步加强，并从规划阶段逐步进入实际落地阶段，我们认为对于互联网巨头企业的合法监管非常必要，只有落实反垄断的监管措施，中小企业的创新才不会扼杀在摇篮中；只有落实对数据的分级管理和保护，个人、企业、国家的数据安全才能得到保障；只有加强教育公平性、与存量资产脱钩，才能确保社会阶级的流动通道保持顺畅。

宏观环境、市场风格发生变化，行业和个股受到负面黑天鹅事件冲击时，本基金即不会直接改变投资策略，转变为自上而下的宏观分析和行业轮换策略，也不会恐慌性的对个股进行操作，而是逐条分析每一个变量对每个公司基本面的影响，重新梳理公司的投资逻辑、盈利预测和估值体系，再按照既定投资策略进行个股选择和仓位调整。我们相信，超额收益恰恰就来源于个别股票大跌时的逆向操作，而这也恰恰是深度研究的价值体现。

应对政策变化的底层前提假设是基于：我们相信政策并不是针对某个行业\公司\企业家，只是针对某个社会实际问题，进行多方面措施的解决。所以我们关注的是这个问题解决后，该行业的核心商业模式是否受到影响，或是否附带影响到其他行业，影响的程度怎

样评估，我们依据以上分析对每个公司进行重新定价，之后再做投资决策。坚持实质重于形式的研究思路，坚持正向推理，这样才能知道未来何时可以再次买入。

#### 4.5.2 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 2.508 元，报告期内，份额净值增长率为 9.95%，同期业绩基准增长率为 4.47%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金的愿景是通过对卓越的新经济行业上市公司，让普通投资者可以分享中国经济快速发展的红利。在过去二十年，国内经济飞速发展，居民财富快速增长，在消费、医药、互联网、科技等新经济行业，一批优秀的企业脱颖而出实现快速增长，带动了房地产行业和私募基金行业的飞速发展，但这两项主流资产配置选项都需要一定的门槛，本基金致力于通过深度研究，尽力发掘一批在未来 3-5 年有长期发展潜力、且具有性价比的优秀上市公司，为普通投资者提供一个平等的资产配置机会，共享中国经济快速发展、优秀企业快速成长的红利。投资不光是基金经理一个人的事情，更是投研团队的整体输出，倡导投研语言一致、充分共享、共同进步的投研文化是实现上述愿景的基础保障。

“基金赚钱，基民不赚钱”一直是困扰整个基金行业的难题，本基金希望不简单以业绩和规模作为目标，而是以基金持有人的收益作为主要考虑因素，为此，本基金在过往报告期内，在三个方面加强了工作：

1) 坚持倡导长期投资理念，鼓励持有者以年为单位投资于本基金。某著名投资人说过“如果你不想在退市时候继续持有一只股票，那么在第一天就不要买入”，投资基金亦是同理，应深入研究选择适合的基金产品，以 2-3 年甚至更长时间作为持有期限。

2) 保持基金风格稳定，专注新经济行业配置和自下而上研究，将资产配置权交还给投资者。本基金在一季度短期内遭遇较大幅度的申购，在对申购资金的建仓时，基金仍按照既定投资策略快速建仓，长期维持较高仓位。同样，在二季度市场风格出现变化时，本基金仍然保持风格稳定，并没有主动选择行业轮动，按照基金合同也无法转移到其他市场，本基金仍主要配置在港股新经济行业的优质个股，并希望长期保持这一风格稳定。

不追求通过行业轮动和仓位调整赚取超额收益，是本基金最重要的基本策略。本基金在实际投资中严格遵循自下而上的投资方法，精力专注于有复利效应的行业和个股研究。

我们认为，港股资产的配置初衷即不应是抄底港股低估值、也不是拥抱全球市场龙头。香港市场是“投资中国”组合中的重要组成部分，是配置中国新经济公司的重要选项。第一，港股和美股是新经济企业上市的重要阵地。据 wind 统计，截止目前，现存上市公司中，大约三分之一市值的中国企业在港股和美股上市，2020 年大约二分之一的上市公司在港股和美股上市（按市值计算），其中新经济板块新上市公司中，选择境外上市的比例更高。

第二，境外上市中，香港市场相较美国的优势已经愈发明显。一方面，中概股回归的趋势已经趋于明朗，目前已经有 20 余家中概股回归港股；另一方面，随着美国监管政策的收紧，要求对中国赴美上市企业审查审计底稿，由于数据安全等原因，境外准备上市和已经上市的企业将加速向港股转移。第三，过去两年，得益于港交所改革，众多优质的新消费、创新药和互联网公司登陆香港市场进行首次上市，已经形成了明显的板块聚集效应，吸引更多优秀的新经济公司赴港上市。这些标的中部分公司具备长期的增长前景，也将为香港市场注入新的活力。我们认为具备深度研究实力的投研团队，可以更好的把握处于早期成长阶段的公司，为投资者更好的筛选标的、创造价值。

本基金立志于成为“投资中国新经济”选项中长期值得信赖的主动管理 QDII 基金。当前时间点，在市场的动荡期内，我们将花更多精力在三个方面：1) 消费、创新药和互联网中各个子行业的二次研究回顾和梳理，全面复盘本次周期中上涨和下跌的主要逻辑，探究股价背后、甚至是基本面变化背后的底层因素。2) 复盘研究方法论，提升我们的研究方法、数据体系的同时，加强投研团队沟通效率、协作能力和组织灵活性。3) 更加注重长期可能发生变革的子行业的深入研究。

我们力争在市场震荡调整期，通过自下而上研究，获取一定的超额收益，同时，我们通过对于长期趋势的底层研究、研究组织的梳理完善，争取再次抓住下一个成长周期。

3) 加强持有人利益的保障，在市场可能出现大幅波动、基金遭遇大幅申赎或其他因素影响现有持有人利益时，主动选择采取限购措施，最大限度保障持有人的利益。根据以上原则，本基金在 1 月末、2 月中两次降低了单日申购上限，并预期会在适时阶段进行放开。

报告期内，基金围绕三个核心逻辑运作：

第一，基金的长期配置战略为新经济领域，包括互联网科技、医药、消费等行业，基金认为这些行业在较长的时间维度下可以跑赢整体市场指数。

目前，中国社会处于快速发展的中期阶段，房地产经济逐渐进入后周期、老龄化社会逐渐形成、高端工程师红利正在释放、社会阶级逐渐稳定下中产阶级焦虑在逐渐形成，90 后、00 后为代表的新一代消费者逐渐成为生力军，科技平权下信息和文化加速传播，我们相信，在这一时代背景下，最能解决社会问题和瓶颈的，以消费、医疗、互联网科技和产业互联网为代表的新经济行业仍会成为推动社会发展的中坚力量。

基金不会因为短期市场热点而变更长期行业配置方向。当前时间点上，基金相对低配高估值的热门板块和个股，超配存在预期差、估值合理、基本面扎实的优质个股。细分行业方面，目前相对看好新兴消费品及零售商、体育服饰、高等教育、医疗服务、CRO、部分细分赛道的创新药和创新医疗器械、to B 互联网、中短视频等未来 3-5 年具备长期成长属性且被低估的子行业。

第二，基金努力实践自下而上、研究驱动的选股方法，利用内部团队投研一体化的体系优势，实现对各细分行业重点股票的全面覆盖，通过深度研究筛选持仓个股，研究方法

包括但不限于公司及终端调研、管理层访谈、专家访谈、量化模型追踪、多维数据监控、专题深度报告，利用深度研究更好的理解行业和商业模式，并利用客观数据检验逻辑假设，以此为基础获取超额收益。本基金坚持将价值投资理念运用于新经济投资领域，坚决不会追逐短期市场概念，不参与盲目抱团，不进行市场投机和炒作。

第三，基金坚持长期投资理念，着眼大机会。新经济公司的商业模式通常具备马太效应、规模效应和网络效应，较长的时间维度下，其商业模式才能被市场充分认知，优势才能得到体现，基金在选择新经济公司时，注重 3-5 年时间维度下的业绩表现及投资回报率，在公司基本面坚实向好、估值具有吸引力的情况下，愿意承受时间成本与市场波动。本基金热衷于投资那些短期基本面扰动因素多、市场处于观望期、但长期逻辑通顺的优质公司，用市场上最稀缺的耐心和时间换取长期确定性的超额收益。投资人的期限有多长，投资的期限就有多长，我们欢迎具备同样投资理念、追求基本面研究的长期投资人至少以 2-3 年为投资维度投资于本基金。最后，基金十分重视风险防控，投资收益是人性在时间维度的复利效应，坚持谦虚谨慎、勤勉尽责的研究态度，坚持逻辑和数据支撑的研究方法是本基金在选股中最大的安全边际。

本基金投资团队通过精选长期优质公司的投资策略，自下而上的分散风险，力争在较长时间维度下战胜业绩比较基准，为投资者创造长期的超额投资收益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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，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 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益

分配方式分两种：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，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.9 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金

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	6.4.5.1	330,771,769.75	105,398,152.27
结算备付金		305,156.52	8,995,755.77
存出保证金		42,205.50	2,763,622.85
交易性金融资产	6.4.5.2	3,037,061,848.15	807,773,403.96
其中：股票投资		3,037,061,848.15	807,773,403.96
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.5.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.5.4	-	-
应收证券清算款		77,485,203.74	-
应收利息	6.4.5.5	10,821.68	7,507.45
应收股利		1,096,290.62	96,394.32
应收申购款		11,495,187.62	20,589,912.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.5.6	-	-
资产总计		3,458,268,483.58	945,624,749.03
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	6.4.5.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		28,498,958.12	18,843,043.63



应付赎回款		110,516,149.76	34,171,508.04
应付管理人报酬		5,144,464.85	1,139,069.81
应付托管费		857,410.82	189,844.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.5.7	295,898.14	112,499.58
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.5.8	359,629.92	185,788.59
负债合计		145,672,511.61	54,641,754.58
所有者权益：			
实收基金	6.4.5.9	1,320,572,379.01	390,583,999.85
未分配利润	6.4.5.10	1,992,023,592.96	500,398,994.60
所有者权益合计		3,312,595,971.97	890,982,994.45
负债和所有者权益总计		3,458,268,483.58	945,624,749.03

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.508 元，基金份额总额 1,320,572,379.01 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金

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		-31,344,665.78	49,680,904.03
1. 利息收入		484,316.07	23,211.94
其中：存款利息收入	6.4.5.11	484,316.07	22,082.39
债券利息收入		-	-
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		-	1,129.55
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-55,627,261.22	14,648,347.68
其中：股票投资收益	6.4.5.12	-71,137,114.21	13,714,947.38
基金投资收益	6.4.5.13	-	-
债券投资收益	6.4.5.14	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.5.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.5.16	-	-
衍生工具收益	6.4.5.17	-1,445,442.87	-
股利收益	6.4.5.18	16,955,295.86	933,400.30
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.5.19	19,853,929.40	34,667,748.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-4,697,148.67	-26,100.93
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.5.20	8,641,498.64	367,696.43
减：二、费用		51,797,864.77	1,895,879.04
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	28,575,190.63	1,026,250.17
2. 托管费	6.4.8.2.2	4,762,531.80	171,041.65
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.5.21	18,162,068.49	593,037.06
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.5.22	298,073.85	105,550.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-83,142,530.55	47,785,024.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以		-83,142,530.55	47,785,024.99

“-”号填列)			
---------	--	--	--

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金

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）	390,583,999.85	500,398,994.60	890,982,994.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-83,142,530.55	-83,142,530.55
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）	929,988,379.16	1,574,767,128.91	2,504,755,508.07
其中：1. 基金申购款	1,735,848,202.01	2,825,162,708.59	4,561,010,910.60
2. 基金赎回款	-805,859,822.85	-1,250,395,579.68	-2,056,255,402.53
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）	1,320,572,379.01	1,992,023,592.96	3,312,595,971.97
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）	58,662,682.09	7,703,592.20	66,366,274.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	47,785,024.99	47,785,024.99

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）	90,837,464.70	36,895,891.79	127,733,356.49
其中：1. 基金申购款	151,191,988.73	56,741,199.81	207,933,188.54
2. 基金赎回款	-60,354,524.03	-19,845,308.02	-80,199,832.05
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）	149,500,146.79	92,384,508.98	241,884,655.77

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 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.4.2 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。

#### 6.4.2.1 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.3.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.3.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.3.3 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。

### 6.4.4 税项

### 6.4.5 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.5.1 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	330,771,769.75
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	330,771,769.75

#### 6.4.5.2 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	2,863,107,054.29	3,037,061,848.15	173,954,793.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,863,107,054.29	3,037,061,848.15	173,954,793.86

#### 6.4.5.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.5.4 买入返售金融资产

##### 6.4.5.4.1 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。

##### 6.4.5.4.2 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。

#### 6.4.5.5 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	6,827.51
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	3,922.88
应收债券利息	-
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	71.29
合计	10,821.68

#### 6.4.5.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.5.7 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	295,898.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	295,898.14

#### 6.4.5.8 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	261,938.79
应付证券出借违约金	-
预提费用	97,691.13
合计	359,629.92

#### 6.4.5.9 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	390,583,999.85	390,583,999.85
本期申购	1,735,848,202.01	1,735,848,202.01
本期赎回（以“-”号填列）	-805,859,822.85	-805,859,822.85

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	1,320,572,379.01	1,320,572,379.01

#### 6.4.5.10 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	-7,033,068.02	507,432,062.62	500,398,994.60
本期利润	-102,996,459.95	19,853,929.40	-83,142,530.55
本期基金份额交易产生的变动数	82,143,611.28	1,492,623,517.63	1,574,767,128.91
其中：基金申购款	151,048,603.16	2,674,114,105.43	2,825,162,708.59
基金赎回款	-68,904,991.88	-1,181,490,587.80	-1,250,395,579.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-27,885,916.69	2,019,909,509.65	1,992,023,592.96

#### 6.4.5.11 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	385,016.54
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	58,034.55
其他	41,264.98
合计	484,316.07

#### 6.4.5.12 股票投资收益

##### 6.4.5.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-71,137,114.21
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-71,137,114.21

##### 6.4.5.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,042,873,644.99
减：卖出股票成本总额	3,114,010,759.20

买卖股票差价收入	-71,137,114.21
----------	----------------

**6.4.5.12.3 股票投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

**6.4.5.12.4 股票投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

**6.4.5.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入**

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

**6.4.5.13 基金投资收益**

本基金本报告期内无基金投资收益。

**6.4.5.14 债券投资收益**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.5.15 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。

**6.4.5.16 贵金属投资收益****6.4.5.16.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.5.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

**6.4.5.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

**6.4.5.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

**6.4.5.17 衍生工具收益****6.4.5.17.1 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。

**6.4.5.17.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6
----	---------------------------------



	月 30 日
股指期货-投资收益	-1,445,442.87

#### 6.4.5.18 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	16,955,295.86
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	16,955,295.86

#### 6.4.5.19 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	19,853,929.40
——股票投资	19,853,929.40
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	19,853,929.40

#### 6.4.5.20 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	8,641,498.64
其他	-
合计	8,641,498.64

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.5.21 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	18,162,068.49
银行间市场交易费用	-
合计	18,162,068.49

### 6.4.5.22 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	38,183.76
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	102,334.65
其他	98,048.07
合计	298,073.85

### 6.4.6 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.6.1 或有事项

无。

#### 6.4.6.2 资产负债表日后事项

无。

### 6.4.7 关联方关系

#### 6.4.7.1 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。

#### 6.4.7.2 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	境外资产托管人
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
南方资本管理有限公司(“南方资本”)	基金管理人的子公司

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。

### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 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	217,154,611.74	2.60%	17,502,355.29	7.90%

### 6.4.8.1.2 基金交易

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基金交易。

### 6.4.8.1.3 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。

### 6.4.8.1.4 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	174,315.23	1.53%	-	-
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	9,203.98	2.51%	9,203.98	33.55%

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。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 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	28,575,190.63	1,026,250.17
其中：支付销售机构的客户维护费	9,482,310.47	18,995.50

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 1.80% 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 × 1.80% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 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	4,762,531.80	171,041.65

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.30% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.8.3 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。

#### 6.4.8.4 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

##### 6.4.8.4.1 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。

##### 6.4.8.4.2 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。

#### 6.4.8.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2015 年 09 月 30 日）持有的基金份额	20,007,444.44	20,007,444.44
报告期初持有的基金份额	25,557,449.99	25,557,449.99
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	25,557,449.99	-
报告期末持有的基金份额	-	25,557,449.99
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	17.10%

基金管理人南方基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

## 6.4.8.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
南方资本管理有限公司	1,346,362.53	0.10%	1,346,362.53	0.34%

## 6.4.8.6 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
中国银行	133,463,256.43	385,016.54	22,137,906.17	19,578.21
中银香港	197,308,513.32	-	9,185,714.25	-

注：本基金由基金托管人中国银行和中银香港保管的银行存款，按银行约定利率计息。

## 6.4.8.7 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。

## 6.4.8.8 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。

## 6.4.9 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 6.4.10 期末（2021 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.10.1 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

6.4.10.1.1 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
2150 HK	奈雪的茶	2021/6/25	2021/12/30	基石配售	16.52	14.25	3,331,000	55,012,724.12	47,450,793.18	-
2171 HK	科济药业-B	2021/6/11	2021/12/18	基石配售	27.07	25.34	2,040,000	55,231,841.28	51,687,145.44	-
6606 HK	诺辉健康-B	2021/2/10	2021/8/18	基石配售	22.14	65.90	582,000	12,888,309.92	38,354,228.35	-
6.4.10.1.2 受限证券类别：债券										
证券	证券名称	成功认购	可流通	流通	认购	期末	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备

代码		日	日	受限 类型	价格	估值 单价	位：张)			注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：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。

#### 6.4.10.2 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。

#### 6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.10.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.11 金融工具风险及管理

##### 6.4.11.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资、基金投资及衍生工具等。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，将风险控制可在承受的范围之内。

#### 6.4.11.2 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行中国银行及境外资产托管人中银香港，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内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，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.11.3 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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.11.3.1 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%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金无流动性受限资产。

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。

#### 6.4.11.4 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。

##### 6.4.11.4.1 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、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.11.4.1.1 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	133,463,256.43	-	-	197,308,513.32	330,771,769.75
结算备付金	305,156.52	-	-	-	305,156.52
存出保证金	42,205.50	-	-	-	42,205.50
交易性金融资产	-	-	-	3,037,061,848.15	3,037,061,848.15
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	10,821.68	10,821.68
应收股利	-	-	-	1,096,290.62	1,096,290.62
应收申购款	445,271.84	-	-	11,049,915.78	11,495,187.62
应收证券清算款	-	-	-	77,485,203.74	77,485,203.74
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	134,255,890.29	-	-	3,324,012,593.29	3,458,268,483.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	110,516,149.76	110,516,149.76
应付管理人报酬	-	-	-	5,144,464.85	5,144,464.85
应付托管费	-	-	-	857,410.82	857,410.82
应付证券清算款	-	-	-	28,498,958.12	28,498,958.12
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	295,898.14	295,898.14
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	359,629.92	359,629.92
负债总计	-	-	-	145,672,511.61	145,672,511.61
利率敏感度缺口	134,255,890.29	-	-	3,178,340,081.68	3,312,595,971.97
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	47,754,703.33	-	-	57,643,448.94	105,398,152.27
结算备付金	8,995,755.77	-	-	-	8,995,755.77
存出保证金	2,763,622.85	-	-	-	2,763,622.85
交易性金融资产	-	-	-	807,773,403.96	807,773,403.96
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	7,507.45	7,507.45
应收股利	-	-	-	96,394.32	96,394.32
应收申购款	614,712.72	-	-	19,975,199.69	20,589,912.41
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	60,128,794.67	-	-	885,495,954.36	945,624,749.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	34,171,508.04	34,171,508.04
应付管理人报酬	-	-	-	1,139,069.81	1,139,069.81

应付托管费	-	-	-	189,844.93	189,844.93
应付证券清算款	-	-	-	18,843,043.63	18,843,043.63
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	112,499.58	112,499.58
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	185,788.59	185,788.59
负债总计	-	-	-	54,641,754.58	54,641,754.58
利率敏感度缺口	60,128,794.67	-	-	830,854,199.78	890,982,994.45

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。

#### 6.4.11.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2020 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.11.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.11.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
银行存款	85,590,435.59	111,721,853.27	-	-	-	197,312,288.86
交易性金融资产	372,485,898.15	2,562,513,916.80	-	-	-	2,934,999,814.95
应收利息	53.88	-	-	-	-	53.88
应收证券清算款	-	77,485,203.74	-	-	-	77,485,203.74
资产合计	458,076,387.62	2,751,720,973.81	-	-	-	3,209,797,361.43
以外币计						

价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口 净额	458,076,387.62	2,751,720,973.81	-	-	-	3,209,797,361.43

项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日					合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产						
银行存款	11,278,249.33	46,369,001.35	-	-	-	57,647,250.68
交易性金融资产	112,022,616.66	695,750,787.30	-	-	-	807,773,403.96
应收股利	-	42,082.00	-	-	-	42,082.00
应收利息	16.25	-	-	-	-	16.25
资产合计	123,300,882.24	742,161,870.65	-	-	-	865,462,752.89
以外币计价的负债						
应付证券清算款	1,493,471.31	2,809,648.75	-	-	-	4,303,120.06
负债合计	1,493,471.31	2,809,648.75	-	-	-	4,303,120.06
资产负债表外 外汇风险敞口 净额	121,807,410.93	739,352,221.90	-	-	-	861,159,632.83

#### 6.4.11.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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 30 日 )	上年度末 ( 2020 年 12 月 31 日 )
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	160,489,868.07	43,057,981.64
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-160,489,868.07	-43,057,981.64	

#### 6.4.11.4.3 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的股

票和基金，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，采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，通过定量与定性相结合的方法分析对宏观经济中结构性、政策性、周期性以及突发性事件进行研判，挖掘未来经济的发展趋势及背后的驱动因素，预测可能对资本市场产生的重大影响，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自上而下”的行业配置策略和“自下而上”的个股选择策略，精选出具有持续竞争优势，且估值有吸引力的股票，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获取超额收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于本基金定义的香港成长股票的投资比例不低于非现金基金资产的 80%。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。

#### 6.4.11.4.3.1 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	3,037,061,848.15	91.68	807,773,403.96	90.66
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	3,037,061,848.15	91.68	807,773,403.96	90.66

#### 6.4.11.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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.组合自身基准上升 5%	138,484,141.81	37,782,399.08

2.组合自身基准下降 5%	-138,484,141.81	-37,782,399.08
---------------	-----------------	----------------

#### 6.4.12 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

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,037,061,848.15	87.82
	其中：普通股	2,664,575,950.00	77.05
	存托凭证	372,485,898.15	10.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	331,076,926.27	9.57
8	其他资产	90,129,709.16	2.61
9	合计	3,458,268,483.58	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股市值为人民币 51,838,375.98 元，占基金资产净值比例 1.56%；通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 200,487,492.62 元，占基金资产净值比例 6.05%。

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	372,485,898.15	11.24
中国香港	2,562,513,916.80	77.36
中国内地	102,062,033.20	3.08
合计	3,037,061,848.15	91.68

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	187,453,005.94	5.66
非必需消费品	1,504,896,310.65	45.43
必需消费品	257,033,719.20	7.76
医疗保健	583,713,806.33	17.62
金融	-	-
科技	157,994,549.24	4.77
通讯	345,970,456.79	10.44
公用事业	-	-
房地产	-	-
政府	-	-
合计	3,037,061,848.15	91.68

注：本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

## 7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值 (人 民币元)	占基 金资 产净 值比 例 (%)
1	Full Truck Alliance Co Ltd	满帮集团	YMM UN	纽约证券交易所	美国	1,423,800	187,453,005.94	5.66
2	Li Ning Co. Ltd.	李宁有限公司	2331 HK	中国香港联合交易所	中国香港	2,060,000	162,495,239.04	4.91
3	ANTA Sports Products Limited	安踏体育用品有限公司	2020 HK	中国香港联合交易所	中国香港	940,000	142,977,970.56	4.32
4	China New Higher Education Group Limited	中国新高教集团有限公司	2001 HK	中国香港联合交易所	中国香港	30,320,000	134,216,500.99	4.05

5	Cathay Media And Education Group Inc.	华夏视听教育集团	1981 HK	中国香港联合交易所	中国香港	29,633,000	133,147,943.86	4.02
6	China Education Group Holdings Limited	中国教育集团控股有限公司	0839 HK	中国香港联合交易所	中国香港	8,839,000	127,384,358.68	3.85
7	Huazhu Group Limited	华住集团有限公司	2943 HK	中国香港联合交易所	中国香港	3,505,850	121,499,200.37	3.67
8	Hygeia Healthcare Holdings Co., Limited	海吉亚医疗控股有限公司	6078 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,319,000	111,946,379.04	3.38
9	Zhou Hei Ya International Holdings Company Limited	周黑鸭国际控股有限公司	1458 HK	中国香港联合交易所	中国香港	13,321,500	103,197,195.13	3.12
10	Akeso, Inc.	康方生物科技(开曼)有限公司	9926 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,957,000	102,018,042.08	3.08
11	China Yongda Automobiles Services Holdings Limited	中国永达汽车服务控股有限公司	3669 HK	中国香港联合交易所	中国香港	8,434,500	97,552,684.77	2.94
12	Kuaishou Technology	快手科技	1024 HK	中国香港联合交易所	中国香港	552,600	89,570,483.08	2.70
13	China Yuhua Education Corporation	中国宇华教育集团有限公司	6169 HK	中国香港联合交易所	中国香港	15,142,000	88,573,468.18	2.67

	n Limited							
14	Man Wah Holdings Limited	敏华控股有限公司	1999 HK	中国香港联合交易所	中国香港	5,668,400	88,011,051.99	2.66
15	Edvantage Group Holdings Limited	中汇集集团控股有限公司	0382 HK	中国香港联合交易所	中国香港	13,508,000	87,445,151.06	2.64
16	Topsports International Holdings Limited	滔搏国际控股有限公司	6110 HK	中国香港联合交易所	中国香港	8,184,000	86,619,927.40	2.61
17	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	0700 HK	中国香港联合交易所	中国香港	156,500	76,048,783.68	2.30
18	CMGE Technology Group Limited	中手游科技集团有限公司	0302 HK	中国香港联合交易所	中国香港	23,486,000	74,455,899.65	2.25
19	Xiaomi Corporation	小米集团	1810 HK	中国香港联合交易所	中国香港	3,200,000	71,891,712.00	2.17
20	Bilibili Inc	哔哩哔哩	BILI UW	纳斯达克证券交易所	美国	87,483	68,857,745.42	2.08
21	Baozun Inc.	宝尊电商	9991 HK	中国香港联合交易所	中国香港	795,000	63,802,022.22	1.93
22	Yadea Group Holdings Ltd.	雅迪集团控股有限公司	1585 HK	中国香港联合交易所	中国香港	4,498,000	62,503,020.53	1.89
23	Pharmaron Beijing Co., Ltd.	康龙化成(北京)新药技术股份有限公司	3759 HK	中国香港联合交易所	中国香港	360,000	62,006,601.60	1.87
24	China East Education Holdings Limited	中国东方教育控股有限公司	0667 HK	中国香港联合交易所	中国香港	5,369,000	54,502,737.74	1.65
25	Ocumensi	欧康维	1477	中国香	中国	2,387,500	54,233,934.30	1.64



	on Therapeuti cs	视生物	HK	港联合 交易所	香港			
26	Innovent Biologics, Inc.	信达生 物制药	1801 HK	中国香 港联合 交易所	中国 香港	700,000	52,741,390.80	1.59
27	Carsgen Therapeuti cs Holdings Limited	科济药 业控股 有限公司	2171 HK	中国香 港联合 交易所	中国 香港	2,040,000	51,687,145.44	1.56
28	Legend Biotech Corp	传奇生 物科技 公司	LEGN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	179,900	47,707,160.19	1.44
29	Nayuki Holdings Limited	奈雪的 茶控股 有限公司	2150 HK	中国香 港联合 交易所	中国 香港	3,331,000	47,450,793.18	1.43
30	Juewei Food Co Ltd	绝味食 品股份 有限公司	603517 SH	上海证 券交易 所	中国 内地	513,488	43,281,903.52	1.31
31	MINISO Group Holding Ltd	名创优 品有限 公司	MNSO UN	纽约证 券交易 所	美国	307,893	41,351,716.85	1.25
32	New Horizon Health Limited	诺辉健 康	6606 HK	中国香 港联合 交易所	中国 香港	582,000	38,354,228.35	1.16
33	Weimob Inc.	微盟集 团	2013 HK	中国香 港联合 交易所	中国 香港	2,600,000	37,037,544.96	1.12
34	China Feihe Limited	中国飞 鹤有限 公司	6186 HK	中国香 港联合 交易所	中国 香港	2,486,000	34,668,912.75	1.05
35	Haidilao Internatio nal Holding Ltd.	海底捞 国际控 股有限 公司	6862 HK	中国香 港联合 交易所	中国 香港	1,000,000	34,032,072.00	1.03
36	JD.com, Inc.	京东集 团股份 有限公	9618 HK	中国香 港联合 交易所	中国 香港	132,850	33,759,474.27	1.02

		司						
37	Betta Pharmaceuticals Co Ltd	贝达药业股份有限公司	300558 SZ	深圳证券交易所	中国内地	278,800	30,177,312.00	0.91
38	Shanghai Bairun Investment Holding Group Co Ltd	上海百润投资控股集团股份有限公司	002568 SZ	深圳证券交易所	中国内地	299,978	28,434,914.62	0.86
39	I-Mab	天境生物	IMAB UQ	纳斯达克证券交易所	美国	50,000	27,116,269.75	0.82
40	Ming Yuan Cloud Group Holdings Limited	明源云集团控股有限公司	0909 HK	中国香港联合交易所	中国香港	690,000	22,132,911.96	0.67
41	Jiumaojiu International Holdings Limited	九毛九国际控股有限公司	9922 HK	中国香港联合交易所	中国香港	334,000	8,823,792.36	0.27
42	Hua Medicine	华领医药	2552 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,452,000	5,654,283.15	0.17
43	Hangzhou Pinming Software Co., Ltd	杭州品茗安控信息技术股份有限公司	688109 SH	上海证券交易所	中国内地	1,301	93,802.10	0.00
44	Chengdu Zhimingda Electronics Co., Ltd	成都智明达电子股份有限公司	688636 SH	上海证券交易所	中国内地	918	74,100.96	0.00
45	Zhejiang Chuangchuang Medical Instrument	归创通桥医疗科技股份有限公司	2190 HK	中国香港联合交易所	中国香港	2,000	71,059.63	0.00

s Co., Ltd						
------------	--	--	--	--	--	--

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Full Truck Alliance Co Ltd	YMM UP	245,748,761.14	27.58
2	Waterdrop Inc	WDH US	171,659,162.15	19.27
3	Cathay Media And Education Group Inc.	1981 HK	145,597,832.16	16.34
4	China Feihe Limited	6186 HK	142,339,942.22	15.98
5	Tencent Holdings Ltd	700 HK	136,541,624.29	15.32
6	Topsports International Holdings Limited	6110 HK	134,401,840.25	15.08
7	China Education Group Holdings Limited	839 HK	133,921,667.87	15.03
8	New Oriental Education & Technology Group Inc.	9901 HK	132,830,905.50	14.91
9	Kuaishou Technology	1024 HK	132,505,829.09	14.87
10	China Yuhua Education Corporation Limited	6169 HK	131,326,486.54	14.74
11	Zhou Hei Ya International Holdings Company Limited	1458 HK	125,053,497.06	14.04
12	ANTA Sports Products Limited	2020 HK	112,561,700.78	12.63
13	China New Higher Education Group Limited	2001 HK	105,970,931.38	11.89
14	Akeso, Inc.	9926 HK	104,134,270.43	11.69
15	CMGE Technology Group Limited	302 HK	101,045,420.90	11.34
16	China East Education Holdings Limited	667 HK	100,958,106.99	11.33
17	RLX Technology Inc	RLX US	100,922,490.82	11.33
18	Man Wah Holdings Limited	1999 HK	94,880,245.02	10.65
19	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	94,301,364.93	10.58
20	Weimob Inc.	2013 HK	91,664,256.12	10.29
21	Vipshop Holdings Ltd	VIPS UN	90,709,086.07	10.18
22	Yadea Group Holdings Ltd.	1585 HK	89,723,634.71	10.07
23	Smooore International Holdings Limited	6969 HK	87,902,024.84	9.87
24	Galaxy Entertainment Group Limited	27 HK	86,560,922.75	9.72
25	Huazhu Group Limited	1179 HK	86,371,570.45	9.69
26	Edvantage Group Holdings Limited	382 HK	85,348,862.68	9.58
27	Hope Education Group Co., Ltd.	1765 HK	82,974,827.36	9.31
28	Viva Biotech Holdings	1873 HK	81,489,465.94	9.15
29	Venus Medtech (Hangzhou) Inc.	2500 HK	80,454,731.69	9.03
30	Scholar Education Group	1769 HK	80,207,170.61	9.00
31	SJM Holdings Limited	880 HK	79,146,628.39	8.88

32	Juewei Food Co Ltd	603517 SH	77,960,381.86	8.75
33	Xiaomi Corporation	1810 HK	75,637,548.05	8.49
34	Hygeia Healthcare Holdings Co., Limited	6078 HK	70,517,204.15	7.91
35	TAL Education Group	TAL US	69,542,144.37	7.81
36	China Yongda Automobiles Services Holdings Limited	3669 HK	69,341,810.00	7.78
37	Shanghai Jinjiang International Hotels Co.,Ltd.	600754 SH	67,118,966.72	7.53
38	China Medical System Holdings Limited	867 HK	66,178,196.71	7.43
39	CSPC Pharmaceutical Group Limited	1093 HK	64,727,683.38	7.26
40	Bilibili Inc	BILI UN	63,810,859.76	7.16
41	New Oriental Education & Technology Group Inc	EDU UN	61,340,995.72	6.88
42	Baozun Inc.	9991 HK	60,378,658.11	6.78
43	Carsgen Therapeutics Holdings Limited	2171 HK	55,231,841.28	6.20
44	Nayuki Holdings Limited	2150 HK	55,012,724.12	6.17
45	Innovent Biologics, Inc.	1801 HK	52,894,404.15	5.94
46	Pharmaron Beijing Co., Ltd.	3759 HK	51,399,515.80	5.77
47	Ocumension Therapeutics	1477 HK	49,898,640.10	5.60
48	Meituan	3690 HK	49,375,493.73	5.54
49	MINISO Group Holding Ltd	MNSO UN	49,103,548.66	5.51
50	JD.com, Inc.	9618 HK	48,644,968.34	5.46
51	Xiabuxiabu Catering Management (China) Holdings Co., Ltd.	520 HK	46,104,171.62	5.17
52	GSX Techedu Inc.	GSX US	46,073,849.39	5.17
53	Legend Biotech Corp	LEGN US	45,722,791.22	5.13
54	Remegen Co., Ltd.	9995 HK	41,012,994.96	4.60
55	Xd Inc.	2400 HK	39,397,494.96	4.42
56	Pinduoduo Inc	PDD US	38,158,472.42	4.28
57	Linklogis Inc.	9959 HK	35,586,094.55	3.99
58	Jinxin Fertility Group Limited	1951 HK	35,394,090.78	3.97
59	Ming Yuan Cloud Group Holdings Limited	909 HK	34,447,648.61	3.87
60	Haidilao International Holding Ltd.	6862 HK	33,699,127.75	3.78
61	Jiumaojiu International Holdings Limited	9922 HK	30,772,164.14	3.45
62	Betta Pharmaceuticals Co Ltd	300558 SZ	30,515,652.04	3.42
63	Shanghai Bairun Investment Holding Group Co Ltd	002568 SZ	28,496,375.65	3.20
64	I-Mab	IMAB UQ	25,440,658.01	2.86
65	Hangzhou Tigermed Consulting Co., Ltd.	3347 HK	25,112,743.79	2.82
66	Genetron Holdings Ltd	GTH US	23,783,100.91	2.67
67	Angelalign Technology Inc.	6699 HK	22,646,598.22	2.54
68	Baozun Inc.	BZUN UW	18,018,975.82	2.02

1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	RLX Technology Inc	RLX US	149,758,192.90	16.81
2	Waterdrop Inc	WDH US	138,602,943.83	15.56
3	Kuaishou Technology	1024 HK	124,229,411.62	13.94
4	China Feihe Limited	6186 HK	118,904,799.07	13.35
5	New Oriental Education & Technology Group Inc.	9901 HK	113,044,153.94	12.69
6	Galaxy Entertainment Group Limited	27 HK	111,251,468.03	12.49
7	SJM Holdings Limited	880 HK	88,631,777.90	9.95
8	Venus Medtech (Hangzhou) Inc.	2500 HK	87,517,920.79	9.82
9	Viva Biotech Holdings	1873 HK	82,389,681.35	9.25
10	CSPC Pharmaceutical Group Limited	1093 HK	77,753,947.35	8.73
11	Scholar Education Group	1769 HK	73,992,889.03	8.30
12	Hope Education Group Co.,Ltd.	1765 HK	73,576,566.42	8.26
13	China Medical System Holdings Limited	867 HK	73,190,273.19	8.21
14	Smooore International Holdings Limited	6969 HK	71,442,451.09	8.02
15	Tencent Holdings Ltd	700 HK	71,220,991.63	7.99
16	Vipshop Holdings Ltd	VIPS UN	66,695,109.28	7.49
17	Zhou Hei Ya International Holdings Company Limited	1458 HK	64,070,179.73	7.19
18	Shanghai Jinjiang International Hotels Co.,Ltd.	600754 SH	59,027,325.98	6.62
19	China Yuhua Education Corporation Limited	6169 HK	58,645,886.90	6.58
20	Remegen Co., Ltd.	9995 HK	56,106,151.81	6.30
21	Jinxin Fertility Group Limited	1951 HK	55,559,206.79	6.24
22	TAL Education Group	TAL US	53,229,359.44	5.97
23	Angelalign Technology Inc.	6699 HK	52,402,783.95	5.88
24	Xiabuxiabu Catering Management (China) Holdings Co., Ltd.	520 HK	49,645,728.29	5.57
25	Hygeia Healthcare Holdings Co., Limited	6078 HK	47,994,224.70	5.39
26	New Oriental Education & Technology Group Inc	EDU UN	47,021,171.40	5.28
27	Topsports International Holdings Limited	6110 HK	46,697,609.29	5.24
28	Akeso, Inc.	9926 HK	45,577,238.68	5.12

29	Weimob Inc.	2013 HK	44,896,475.87	5.04
30	Meituan	3690 HK	43,284,328.77	4.86
31	Pinduoduo Inc	PDD US	42,191,777.75	4.74
32	Genetron Holdings Ltd	GTH US	41,369,660.17	4.64
33	Linklogis Inc.	9959 HK	38,258,819.51	4.29
34	Bilibili Inc	BILI UN	36,992,627.89	4.15
35	CMGE Technology Group Limited	302 HK	35,859,856.56	4.02
36	Full Truck Alliance Co Ltd	YMM UP	34,087,497.30	3.83
37	JD.com, Inc.	9618 HK	33,830,165.63	3.80
38	Jiumaojiu International Holdings Limited	9922 HK	33,594,801.63	3.77
39	Gaotu Techedu Inc	GOTU US	31,595,526.66	3.55
40	Hangzhou Tigermed Consulting Co., Ltd.	3347 HK	31,386,455.58	3.52
41	Xd Inc.	2400 HK	30,375,099.50	3.41
42	Man Wah Holdings Limited	1999 HK	30,229,075.20	3.39
43	Ming Yuan Cloud Group Holdings Limited	909 HK	27,373,307.95	3.07
44	Juewei Food Co Ltd	603517 SH	24,329,794.00	2.73
45	ANTA Sports Products Limited	2020 HK	24,229,130.81	2.72
46	Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Limited	6989 HK	20,945,413.82	2.35
47	MINISO Group Holding Ltd	MNSO UN	20,656,294.45	2.32
48	3SBio Inc.	1530 HK	20,445,115.07	2.29
49	Baozun Inc.	BZUN UW	20,376,520.77	2.29

1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	5,323,205,772.59
卖出收入（成交）总额	3,042,873,644.99

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。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.8 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。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 7.10 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

本基金本报告期末未持有基金。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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	42,205.50
2	应收证券清算款	77,485,203.74
3	应收股利	1,096,290.62
4	应收利息	10,821.68
5	应收申购款	11,495,187.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	90,129,709.16

### 7.11.4 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债券。

### 7.11.5 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
307,315	4,297.13	107,586,005.76	8.15%	1,212,986,373.25	91.85%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

无。

### 8.3 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	10,415,262.16	0.7887%

### 8.4 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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年9月30日)基金份额总额	459,296,083.13
本报告期期初基金份额总额	390,583,999.85
本报告期基金总申购份额	1,735,848,202.01
减：报告期基金总赎回份额	805,859,822.85
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	1,320,572,379.01

## § 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。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
China International Capital Corporation	-	1,778,991,112.65	21.26%	2,902,261.62	25.47%	-

Hong Kong Securities Limited						
China Renaissance Securities (HK) Limited	-	1,460,210,501.84	17.45%	2,130,162.14	18.70%	-
Haitong International Securities Co.,Ltd	-	1,172,476,403.77	14.01%	1,362,787.90	11.96%	-
UBS Securities Asia Limited	-	1,014,413,203.33	12.13%	1,034,218.88	9.08%	-
广发证券	1	641,062,748.11	7.66%	565,438.85	4.96%	-
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	-	608,121,740.97	7.27%	674,150.58	5.92%	-
China Merchants Securities(HK)Co Ltd	-	412,831,148.24	4.93%	428,178.02	3.76%	-
天风证券	1	372,583,730.81	4.45%	310,787.30	2.73%	-
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	319,680,621.77	3.82%	284,821.38	2.50%	-
华泰证券	1	217,154,611.74	2.60%	174,315.23	1.53%	-
GuangFa Securities (Hong Kong)Business Limited	-	206,009,093.44	2.46%	272,541.20	2.39%	-
Credit Suisse(Hong Kong) Limited	-	57,095,057.28	0.68%	552,318.41	4.85%	-
CMB International Securities Limited	-	55,012,724.12	0.66%	550,127.24	4.83%	-
Sanford C. Bernstein Limited	-	20,391,044.84	0.24%	28,464.73	0.25%	-
华盛证券	-	16,205,750.00	0.19%	-	-	-
CLSA Limited	-	13,839,924.67	0.17%	122,840.90	1.08%	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

### 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
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-
China Renaissance	-	-	-	-	-	-

Securities (HK) Limited						
Haitong International Securities Co.,Ltd	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities(HK)Co Ltd	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
GuangFa Securities (Hong Kong)Business Limited	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse(Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
CMB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein Limited	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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。

## 10.8 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	关于南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金 2021 年境外主要市场节假日申购赎回安排的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-05
2	南方基金管理股份有限公司关于北京恒宇天泽基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-07
3	南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购和定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-07
4	南方基金关于旗下部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为销售机构的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-28
5	南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金限制大额申购和定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02
6	南方基金管理股份有限公司关于调整旗下南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金申购和定投金额限制的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-20
7	南方基金关于旗下部分基金增加红塔证券为销售机构及开通相关业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-03
8	南方基金关于旗下部分基金增加中原银行为销售机构及开通相关业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-03
9	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-26
10	南方基金关于旗下部分基金增加坤元基金为销售机构及开通相关业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-01
11	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
12	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金申	证券日报、基金管理	2021-04-08

	购费率优惠标准的公告	人网站、中国证监会 基金电子披露网站	
13	南方基金关于旗下部分基金增加华泰期货为销售机构及开通相关业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2021-04-22
14	南方基金关于旗下部分基金增加恒泰证券为销售机构及开通相关业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2021-05-14
15	南方基金关于旗下部分基金增加普益基金为销售机构及开通相关业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2021-06-07
16	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2021-06-08
17	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2021-06-18

## § 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香港成长灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方香港成长灵活配置混合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、《南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金 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>