

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

2021 年 09 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 10 月 27 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)
基金主代码	011696
交易代码	011696
基金运作方式	其他开放式
基金合同生效日	2021年4月20日
报告期末基金份额总额	913,166,743.63份
投资目标	本基金是基金中基金，优选多种具有不同风险收益特征的基金，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金力争通过合理判断市场走势，合理配置基金、股票、债券等投资工具的比例，通过定量和定性相结合的方法精选具有不同风险收益特征的基金，力争实现基金资产的稳定回报。本基金的主要投资策略为基金投资策略，本基金在开放式基金投资方面，基于南方基金基金评价系统对全市场基金公司及其管理的基金的评级，将力求投资于管理规范、业绩优良的基金管理公司的基金，以分享资本市场的成长。
业绩比较基准	万得偏股混合型基金指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金中基金、债券型基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风

	险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)A	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)C
下属分级基金的交易代码	011696	011697
报告期末下属分级基金的份额总额	893,863,500.84份	19,303,242.79份

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方浩睿FOF”。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年7月1日—2021年9月30日）	
	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)A	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)C
1.本期已实现收益	-16,437,324.91	-376,021.48
2.本期利润	-34,541,980.18	-743,414.87
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0347	-0.0346
4.期末基金资产净值	881,446,983.15	19,001,134.37
5.期末基金份额净值	0.9861	0.9843

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、本基金T日的基金份额净值在所投资基金披露净值或万分收益的当日（法定节假日顺延至第一个交易日）计算，并于T+3日公告。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④

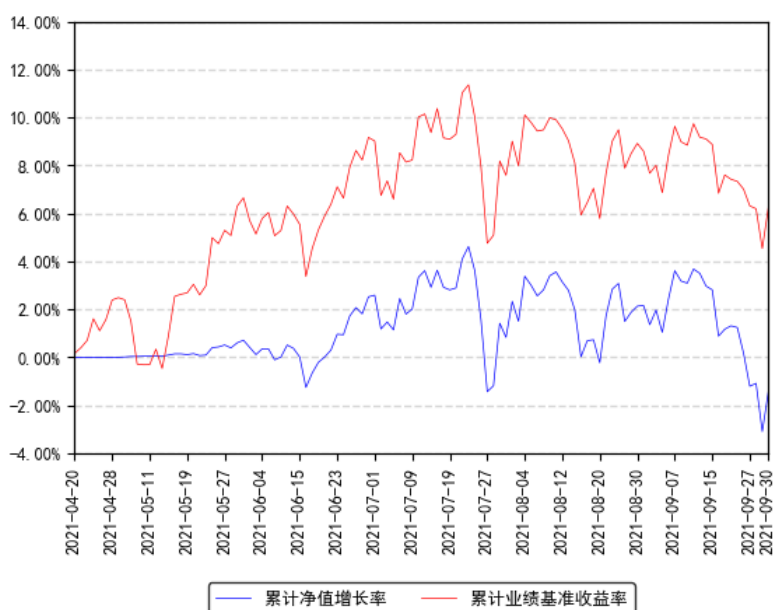
		②		准差④		
过去三个月	-3.81%	1.06%	-2.63%	1.11%	-1.18%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-1.39%	0.82%	6.30%	0.99%	-7.69%	-0.17%

南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)C

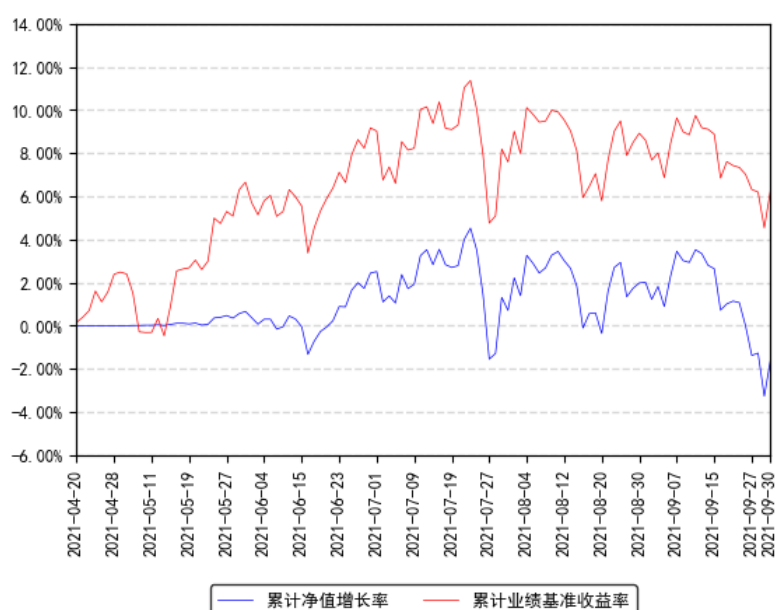
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.91%	1.06%	-2.63%	1.11%	-1.28%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-1.57%	0.82%	6.30%	0.99%	-7.87%	-0.17%

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

南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于2021年4月20日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起6个月内为建仓期，截至报告期末基金尚未完成建仓。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

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

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

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾三季度，虽然二季度德尔塔病毒变异导致疫情在欧洲快速传播至全球，但在加强疫苗接种下，欧美疫情逐渐在 8 月至 9 月期间得以控制。国内部分地区也受到德尔塔病毒传播影响，但疫情控制良好，并未出现大规模传播。在国内能耗双控，海外供需不平衡的情况下，大部分商品价格进一步走高。通胀快速抬升的背景下，市场对于美联储加息的预期逐渐强烈。美债收益率快速上行，中国国债收益率受降准影响在 7 月份大幅下跌后略有反弹，再度进入区间震荡。三季度，全球股票市场表现分化，发达市场表现平稳，新兴市场下跌。国内方面，三季度各指数普遍下跌。板块方面，各行业表现进一步分化。受益于供需紧张，商品价格上涨的上游资源如煤炭、有色、公用事业涨幅 20%以上，偏下游消费的食品饮料、医药生物和休闲服务下跌幅度则在 10%以上。

南方浩睿进取京选 FOF 在 8 月中旬基本完成股票基金配置以及股票底仓构建。符合合同规定的偏股及股票型基金占比约 80%。8 月份以来受市场波动影响，组合净值出现小幅回调。组合自成立以来坚持从全市场精选基金，并采用核心+卫星的方式构建组合。核心部分主要

由投研经验丰富、中长期业绩表现稳健、风险控制能力较好的成长、价值、均衡成长、均衡风格主动管理基金构成。核心部分基金配置比例占比65%以上。卫星部分主要由指数、指数增强、医药、新能源、消费、科技等主动管理型基金构成，占比约15%。为参与科创板新股申购，组合参与股票底仓配置。股票配置较为分散，前五大行业分别为电力设备及新能源、化工、食品饮料、建筑、医药。成立以来，股票仓位收益未给组合造成拖累，处于持平。

进入9月以来，组合适当进行了调仓。考虑到国内反垄断政策尚未明朗，而港股后续可能受到来自美联储提前加息，资产回流美元的影响，因此组合降低了港股配置比例较高，且港股互联网龙头配置较高的沪港深基金占比。市场波动情况下，组合赎回量加大，考虑到组合结构调整，因此赎回了部分规模较大，业绩表现持续偏落后的基金以便应对流动性需要和调仓需要。考虑到中证500和中证1000指数估值仍然较低，且盈利预期强于沪深300和上证50，因此组合适当增加了规模适中，过往业绩表现稳健的中证500增强指数基金和中证1000增强指数基金配置。在市场风格快速变换的背景下，不少主动管理型基金经理的投资风格和过往的行业配置也出现大幅漂移的情况，配置过程中可很难获得相应暴露；而规模过大的基金经理也可能存在组合中板块调整滞后的情况，因此组合小幅度增加了主题基金作为卫星配置，以保证组合在部分行业和板块的暴露相对稳定。今年以来，受政策和前期高估值影响，医药和消费板块整体调整幅度较大或逐步迎来配置机会。因此组合逐渐增加了消费和医药两大行业主题基金配置比例，目前消费基金占比不到1%，医药基金占比1.15%。后续计划医药和消费主题基金的配置比例分别不超过3%。整体风格上来看，目前组合的风格均衡略偏成长。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金A份额净值为0.9861元，报告期内，份额净值增长率为-3.81%，同期业绩基准增长率为-2.63%；本基金C份额净值为0.9843元，报告期内，份额净值增长率为-3.91%，同期业绩基准增长率为-2.63%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	87,803,165.17	9.61
	其中:股票	87,803,165.17	9.61
2	基金投资	714,790,774.61	78.25
3	固定收益投资	55,246,677.30	6.05
	其中:债券	55,246,677.30	6.05
	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	29,733,398.25	3.25
8	其他资产	25,938,511.73	2.84
9	合计	913,512,527.06	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	7,315,001.00	0.81
C	制造业	41,328,117.72	4.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,693,600.00	0.74
E	建筑业	7,170,000.00	0.80
F	批发和零售业	1,410,500.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,620,183.45	1.07
J	金融业	8,518,595.00	0.95
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,536,000.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	4,211,168.00	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	87,803,165.17	9.75

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合



本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601668	中国建筑	900,000	4,320,000.00	0.48
2	603259	药明康德	27,560	4,211,168.00	0.47
3	601877	正泰电器	65,400	3,701,640.00	0.41
4	600483	福能股份	200,000	3,648,000.00	0.41
5	600887	伊利股份	91,000	3,430,700.00	0.38
6	603613	国联股份	30,000	3,423,600.00	0.38
7	000975	银泰黄金	370,000	3,141,300.00	0.35
8	600461	洪城环境	360,000	3,045,600.00	0.34
9	600406	国电南瑞	84,000	3,016,440.00	0.33
10	002948	青岛银行	609,500	2,919,505.00	0.32

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。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	55,246,677.30	6.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	55,246,677.30	6.14

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019654	21 国债 06	430,000	43,038,700.00	4.78
2	019645	20 国债 15	121,970	12,207,977.30	1.36

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

## 5.11 投资组合报告附注

**5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明。**

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明。**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

## 5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	109,650.73
2	应收证券清算款	24,870,989.18
3	应收股利	37.42
4	应收利息	745,041.16
5	应收申购款	209,004.14
6	其他应收款	3,789.10
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,938,511.73

## 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 基金中基金

## 6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资 产净值比 例 (%)	是否属于 基金管理 人及管理 人关联方 所管理的 基金
1	007130	中庚小盘 价值股票	契约型开 放式	23,665,52 5.24	54,873,25 3.37	6.09	否
2	004235	中欧价值 智选回报 混合 C	契约型开 放式	9,705,864 .38	45,725,29 7.68	5.08	否
3	005794	银华心怡 灵活配置 混合	契约型开 放式	12,617,67 2.92	42,385,28 6.87	4.71	否
4	007217	浙商智能 行业优选 混合 C	契约型开 放式	23,410,03 4.97	42,072,51 4.85	4.67	否
5	070019	嘉实价值 优势混合	契约型开 放式	15,367,02 3.21	37,326,49 9.38	4.15	否

6	002846	泓德泓华 灵活配置 混合	契约型开 放式	14,368,60 7.89	33,784,90 7.73	3.75	否
7	750001	安信策略 精选灵活 配置混合	契约型开 放式	11,895,81 8.31	33,367,77 0.36	3.71	否
8	002808	泓德优势 领航灵活 配置混合	契约型开 放式	14,975,33 6.62	32,836,42 0.61	3.65	否
9	009108	富国红利 精选混合 (QDII)	契约型开 放式	18,298,21 4.48	32,323,79 5.88	3.59	否
10	005276	中欧创新 成长灵活 配置混合 C	契约型开 放式	14,998,46 3.64	32,228,69 8.67	3.58	否

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021-07-01 至 2021-09-30	其中：交易及持有基金管理人 以及管理人关联方所管理基 金产生的费用
当期交易基金产生的申购费 (元)	7,399.96	-
当期交易基金产生的赎回费 (元)	548,992.38	43,540.61
当期持有基金产生的应支付 销售服务费(元)	406,795.74	17,309.92
当期持有基金产生的应支付 管理费(元)	2,819,899.34	180,923.77
当期持有基金产生的应支付 托管费(元)	487,039.52	38,575.94

## 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

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

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方浩睿进取京选3个月持 有混合(FOF)A	南方浩睿进取京选3个月持 有混合(FOF)C
----	---------------------------	---------------------------

报告期期初基金份额总额	1,096,998,147.51	24,110,032.21
报告期期间基金总申购份额	8,453,243.13	1,743,570.98
减：报告期期间基金总赎回份额	211,587,889.80	6,550,360.40
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	893,863,500.84	19,303,242.79

## § 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、《南方浩睿进取京选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》；
- 2、《南方浩睿进取京选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)托管协议》；
- 3、南方浩睿进取京选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)2021 年 3 季度报告原文。

### 10.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 10.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>