

# 南方科技创新混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 10 月 26 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	南方科技创新混合
基金主代码	007340
交易代码	007340
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 6 日
报告期末基金份额总额	1,169,409,248.78 份
投资目标	本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化行业深度研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*10%+上证国债指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。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。本基金可投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方科技创新混合 A	南方科技创新混合 C
下属分级基金的交易代码	007340	007341
报告期末下属分级基金的份额总额	977,338,120.98 份	192,071,127.80 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“南方科技创新”。

### § 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（2022 年 7 月 1 日—2022 年 9 月 30 日）	
	南方科技创新混合 A	南方科技创新混合 C
1.本期已实现收益	177,443,952.97	33,584,018.71
2.本期利润	-229,596,208.67	-44,067,480.22
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2417	-0.2343
4.期末基金资产净值	2,374,159,710.40	454,100,868.13
5.期末基金份额净值	2.4292	2.3642

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 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

南方科技创新混合 A

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

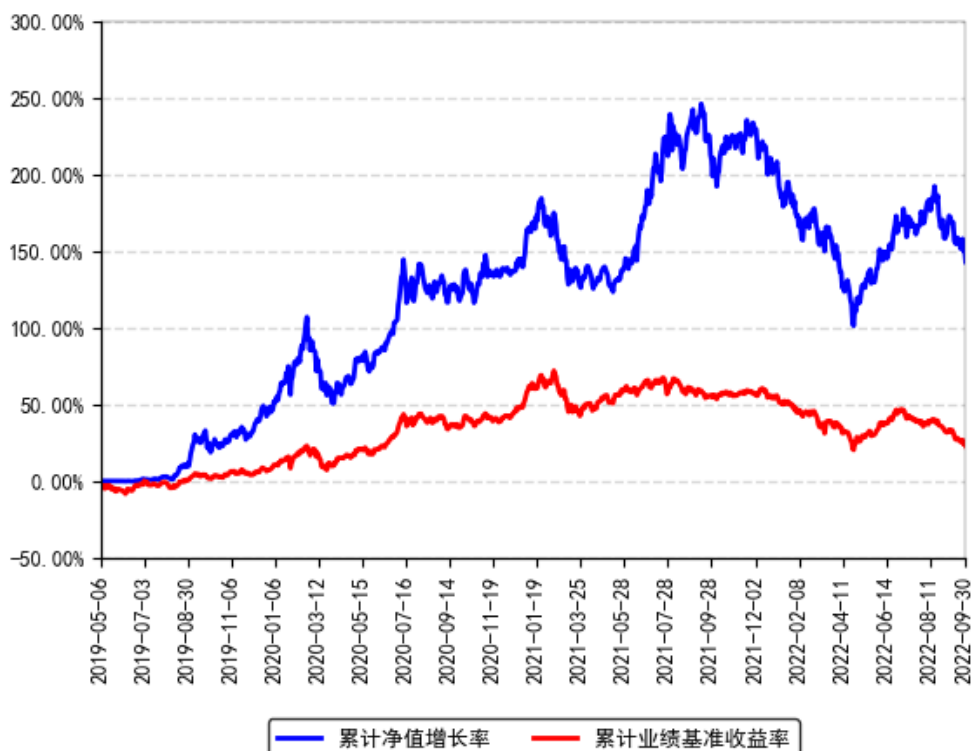
过去三个月	-8.82%	1.81%	-15.46%	0.87%	6.64%	0.94%
过去六个月	-1.62%	1.95%	-10.02%	1.12%	8.40%	0.83%
过去一年	-21.71%	1.92%	-21.32%	1.05%	-0.39%	0.87%
过去三年	100.69%	2.00%	20.79%	1.11%	79.90%	0.89%
自基金合同生效起至今	142.92%	1.92%	22.92%	1.09%	120.00%	0.83%

南方科技创新混合 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	-9.00%	1.81%	-15.46%	0.87%	6.46%	0.94%
过去六个月	-2.01%	1.95%	-10.02%	1.12%	8.01%	0.83%
过去一年	-22.34%	1.92%	-21.32%	1.05%	-1.02%	0.87%
过去三年	95.96%	2.00%	20.79%	1.11%	75.17%	0.89%
自基金合同生效起至今	136.42%	1.92%	22.92%	1.09%	113.50%	0.83%

### 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

南方科技创新混合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



南方科技创新混合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



## § 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		
王博	本基金基金经理	2019年11月11日	-	7年	清华大学工学硕士，具有基金从业资格。2015年7月加入南方基金，任权益研究部行业研究员，现任TMT研究组组长。2018年9月25日至2019年11月11日，任南方瑞合基金经理助理；2019年11月11日至今，任南方科技创新混合基金经理；2020年6月12日至今，任南方成长先锋混合基金经理；2020年7月28日至今，任科创板基金基金经理。

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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益。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

异常交易行为的专项说明：本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 2 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

### 一、对过去操作的总结

2022 年前三季度，南方科技创新下跌了 21.19%，基准下跌 21.10%，基准中的股票部分指数中证战略新兴成分指数下跌 31.66%，我们跑平基准，没有获取超额收益。分析原因，一方面我的仓位一般在 80-95%，基准股票仓位 70%，在今年这样下跌的市场中，高仓位往往会跑输；另一方面，主要是今年在选行业和选股上面出现了一些困难，TMT 行业的持仓在 40-50%，今年竟然面临无票可买的窘境，而新能源方面今年大票表现不佳，中小市值公司热点层出不穷，有些跟不上节奏。整体看，我对前三季度的操作还是认为存在较大改善空间，这部分会在我后续的持仓中体现。

在年中的时候我又申购了较多我的基金，目前仍然处于略亏损状态。虽然我的考核是跑赢基准及同类基金，但绝对收益仍然是我本质上追求的目标。心痛的同时我已经较大程度上进行了操作上的优化，后续对产品的运作仍然可以期待。

目前仍然保持较高仓位运作，仓位保持在 80-95%。一方面基金经理都不太擅长大波段的宏观择时，而且基金合同和合规方面也有最低仓位的限制要求，我们的目标是通过选股获取超额收益。另一方面，目前大盘经过年内第二轮下跌，很多公司的机会又来了，这个位置

上战略上尽量不要悲观。经过我们的一系列的分析，结论化作一句话就是“3000 点以下千万不要悲观”，我目前已经开始按月定投自己的产品。

我觉得买基金主要要搞清楚根本的两个问题：这只基金投资范围是什么，基金经理是什么风格。本只基金不是全市场基金，是一只聚焦在新兴成长行业也就是科技行业的基金，投资范围包含了新兴成长行业的三大分支，即 TMT、新能源、高端装备，比较基准也包含了中证战略新兴产业成分指数。我会严格按照基金合同约定的行业进行投资，不会发生行业的偏离。目前本只产品的投资范围按照行业分类是：电子、电力设备、计算机、基础化工、机械设备，如果按照二级行业分类是：锂电池、半导体、消费电子、光伏、能源金属、软件互联网。所以一定分清我的产品的投资方向，我在运作中基于我的基准保持了相对均衡的行业配置，通过选股获取超额收益。由于产品风格定位为新兴成长，所以没有配置周期板块和传统消费等。在后续操作中，仓位上仍然不会有大的择时，行业方面我会根据预期收益率和基准情况及时调整。

今年，科技股的表现称得上是过去十年最差，代表性行业电子行业跌幅超过了 40%，很多个股年初至今跌幅超过 50%，我们的基金也录得了一定的亏损。在年初的时候我还是比较沮丧，但到了下半年我越来越乐观。我想和各位持有人说两个事情。首先，有一个特别简单的常识，对于一个长期向好的资产，低位的时候永远可以更乐观一些，高位的时候可以更谨慎一些。目前很多优秀的公司，因为行业的波动和宏观经济的波动，股价处于特别的低位，那么一旦外部因素向好，公司的业绩和估值弹性往往会带来特别丰厚的收益，机会往往都是跌出来的。第二，关于长期和短期，很多人特别在意短期的走势，因为不相信长期的判断，因为想短线投机，强行编造买入理由说服自己，然后亏钱了到处问为什么。其实长期来看，这些都是短期的扰动，时间会熨平短期的痛苦并给坚持的人丰厚的回报。

关于选股，我认为市场的收益主要来自于两个方面：第一是产业趋势，第二是优秀公司的长期经营回报。其实市场里存在大量平庸的公司、少数优秀的公司。在普通公司里面比来比去有时候意义不大，大家都是靠周期吃饭，上行周期一起吃饭，下行周期一起吃面，即便比别人略微努力一点也挡不住这个大势。所以很多公司的涨跌，主要还是风口，或者说产业趋势。

但优秀公司就不一样了，哪怕只比同行持续好一点点，市场都会给很高的溢价，因为赢家通吃的规则在很多行业是生效的。所以买优秀公司的时候必须仔细研究、认真研究，多增加一分的确定性，也许就决定着长期收益水平。当然，对于逻辑被证伪，陷入经营困难的公司，要义无反顾的第一时间卖出。

我们的投资，收益来主要是这两方面，但长期看，收益来源主要是优秀公司的成长性。我们致力于以公道的价格买入优秀的公司，因为优秀公司会不断创造现金流和超额收益，争取做到买入当前的价格低于股票未来的内在价值。

所以，在目前市场如此惨烈的时点，我们更要坚定信心，要相信好行业好公司给我们带来的长期回报。

## 二、对市场的观点

关于板块。科技板块中表现最佳的是新能源汽车与风电光伏等新能源方向，核心产业逻辑是在全球追求绿色能源，加速实现“碳中和、碳达峰”的大背景下，中国高端制造业在新能源汽车产业链和风电光伏产业链具有明显的竞争优势，叠加疫情全球供给严重不足的局面下，中国相关产业链取得高速业绩成长，并成长为全球最具竞争力的产业链公司。而半导体行业之所以在 TMT 行业中相对表现还可以，是因为中国提前布局自主可控，在贸易摩擦下推动国产化替代，并借助疫情全球芯片紧缺的大环境，实现产业链破局，并实现了客户体系的改善。而表现相对弱勢的几个行业，大部分均为 2020-2021 年涨幅较大，且出现了行业政策限制反垄断或景气度下行等负向基本面因素。总体来看，2022 年科技行业各个板块的表现继续充分展现了中国各个科技细分领域的基本面变化方向。

关于风格。今年大小票风格分化明显，景气行业与顺周期行业分化明显，这是市场逐步成熟的一个体现，全面牛市和全面熊市的概率在未来是下降的，我们都要对这种结构性市场逐渐适应。目前宏观宽货币紧信用，信用利差收窄，这种情况下头部公司的盈利确定性下降，市场风格一般是均衡或偏向小票。这种风格从 2021 年初就开始了，一般情况根据经济周期会持续三年。我必须很坦诚地说，这种风格不利于规模较大的基金，因为基本上调仓换股相对来说会困难很多。但我们只要再坚持一下，到了明年下半年市场风格就可能转变，叠加下跌较多的 TMT 行业，或许又会是一轮比较大的行情。忍耐并不可怕，可怕的是看不到希望的无谓坚持，目前对于科技行业来说处在黎明前的黑暗，希望就在眼前。

## 三、对未来的展望

在操作思路，我会及时调整行业和公司分布，尽量避免配置型品种，减少刚蹭式亏损。配置型品种是我今年以来亏损最大的来源，很多亏损来自于白马的随市场下跌。另外，我将提升持仓集中度，降低个股的数量，尽量避免在不完全熟悉的环境中新增投资品种。

在宏观环境上，我们国家目前处于一个转折点，一方面人口红利和城镇化红利接近尾声，从传统房地产行业集群向新兴成长行业进行切换；另一方面国际形势风云变幻，叠加疫情冲击，外部环境变得越来越脆弱，不确定性在累积。这种情况下，新兴成长行业一定是中国实现第二成长曲线的重要推动力，如果新兴成长行业都没有机会，那么其他行业的预期回报率可能更低。我们对新兴成长行业，尤其是科技行业抱有充分的信心，这信心不止来自于我们对宏观，对历史的分析总结，也包括对微观层面上各行业的跟踪研究。所以我们看好成长股，看好科技股的未来空间。



在行业选择上，成长行业买的是公司的成长空间。整体来看，由于科技行业在 2020 年中景气度开始回落，从 2020 年后我的管理风格基本在 TMT 和新能源等新兴行业里面均衡配置，对单一行业的配置不是特别集中。相对中证战略新兴成分指数来说，我是超配了 TMT，低配了新能源。目前看，新能源今年的表现远好于其他行业，而科技板块大跌后处于底部盘整状态。一般来看全年主线不会轻易发生变化，投资机会目前仍处于结构性扩散阶段，基金经理继续挖掘新公司的投资机会。对于底部不反弹的 TMT 行业，基金经理保持一定配置，待基本面转好加大配置。

对于后市判断，我们基于景气、估值、确定性，将公司分为两类：第一类是强预期强现实类行业，即高景气成长股，整体对高成长性的板块维持超额收益观点。第二类是强预期弱现实类行业，即无业绩支撑，同时叠加 2023 年及未来想象空间的行业，会始终存在阶段性行情，需要及时兑现。2023 年全年行情将在上述两类之间切换进行，需要重视持仓的性价比及时调整。

在新兴成长行业中，产业趋势目前仍然保持高景气的有：碳中和相关、国产自主化相关、汽车智能化和零组件国产化相关；产业趋势目前在底部的有：半导体设计封测相关、新兴消费电子相关、信息化软件及云计算相关。

具体到科技细分领域来说：

半导体维持高景气度，在 TMT 四个行业中最看好，尤其是半导体设备和汽车半导体。半导体的行业空间足够大，产业链纵深长。目前国内的半导体还处于高速增长阶段，所以估值相对高，类似于十年前的消费电子。国内增长快主要因为国产化厂商的份额在提升。2018 年半导体被制裁之后，国内的客户对国产半导体厂商的接受程度大幅提升。其实当时主要就是一个临界点，给了国产半导体公司一个机会，加上国家政策和资本市场的扶持，所以率先从最简单的逻辑类 IC、一部分模拟 IC 开始，国内半导体公司的份额大幅提升，2019 年出现了很多牛股。半导体现阶段我最看好的是设备公司，虽然出现了最新的海外限制政策，但用时间换空间，制造之母的设备行业在脱钩的大背景下反而增大了长期的市场空间。2018 年后设备国产化渗透率也随着 IC 设计一起提升，从 2018 年内的 9%提升到了 2021 年的 17%，在 2021 年后，国内的半导体设计公司的成长速度陡然提升，后面这个趋势会保持 3-5 年。第二个就是汽车电动化智能化对应的半导体，每年行业都是翻倍增长，汽车的半导体用量大幅提升了。

智能硬件主要看 2022 年上半年的 MR（混合虚拟现实设备）和汽车智能化，但 MR 的预期过高，目前缺乏爆款产品和应用，相关标的全年走势可能一波三折，无业绩支撑的估值难以持续。被动元器件等板块短期景气度较弱，低估值的 PCB 与苹果产业链板块，要观察手机能否销量复苏，绝对收益的机会。

汽车智能化是在汽车电动化后的又一大产业趋势，电动车产业链解构了传统油车的全球供应格局，使得很多国内的汽车零部件公司扩展客户。同时汽车上的电子功能越来越丰富，汽车成为了一个移动智能终端，相关公司的机会很多。

传媒互联网方面受政策影响过大，关注政策的连续性是否持续。元宇宙主题有分化，比较强势的是新有链游和 nft 新故事的公司。

计算机方面，仍然缺乏大的行业产业发展逻辑，但我们认为在 2022 年四季度开始，随着政府换届结束，政府在信息化的开支将会重回增长。两条主线云计算和国产化，预计 23 年是系统性行情较好时机，个股行情将精彩纷呈，起步估值低的中市值公司中的高成长个股值得重点关注。

碳中和相关 储能技术路径将落地，将解决消纳问题和成本问题，产业即将迎来爆发增长，看好相关产业链；光伏行业硅料价格高位情况下需求较好，若 23 年硅料价格下行将进一步激发需求。

综上，科技行业是成长股的摇篮，也是中国新经济的引擎。国内科技行业伴随全球产业转移升级，走出了一条从制造到研发，从成本优势到创新优势的中国特色道路。展望未来，一方面科技创新永不停止，在医药、新能源、人工智能方面的巨大潜力刚刚被挖掘，另一方面我国的经济新旧动能转换也离不开科技创新的支持。从历史上看，每次大危机都具有强烈的再分配效应，它将导致大国实力的转移和国际经济秩序的重大变化，这也就更加坚定我们对我国经济转型升级的信心。

展望未来，中国走到了经济转型升级的十字路口，在新能源、高端装备、零组件制造等领域的领先优势将会保持，在生物技术和半导体等领域也将迎头赶上。凭借本土的企业家精神和工程师红利，凭借凝聚全球资源的决心和胸怀，将有一批新兴产业创造出巨大的价值。在后续的基金管理中，我们将继续挑选优秀公司，陪伴企业成长，期待投资者朋友们与我们一同享受科技创新、产业升级的红利。

再次感谢您的每一份托付！我们将坚持“价值创造”的核心理念，均衡配置，精选个股，积极挖掘中国成长行业中所蕴含的机会，尽力实现投资价值的增长，为您的财富保驾护航。

#### 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 2.4292 元，报告期内，份额净值增长率为-8.82%，同期业绩基准增长率为-15.46%；本基金 C 份额净值为 2.3642 元，报告期内，份额净值增长率为-9.00%，同期业绩基准增长率为-15.46%。

#### 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	2,236,242,226.59	78.52
	其中：股票	2,236,242,226.59	78.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	126,348,960.28	4.44
	其中：债券	126,348,960.28	4.44
	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	-147,101.32	-0.01
	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	307,901,496.06	10.81
8	其他资产	177,580,396.32	6.24
9	合计	2,847,925,977.93	100.00

注：本基金本报告期末通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 80,250,273.83 元，占基金资产净值比例 2.84%。

### 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	47,490.00	0.00
C	制造业	2,148,952,368.69	75.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,120.04	0.00
E	建筑业	6,220,480.00	0.22
F	批发和零售业	43,066.08	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	52,226.70	0.00
H	住宿和餐饮业	13,970.88	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	278,376.13	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	301,890.24	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	45,964.00	0.00

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	2,155,991,952.76	76.23

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

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	-	-
非必需消费	-	-
必需消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
科技	-	-
通讯	-	-
公用事业	80,250,273.83	2.84
房地产	-	-
政府	-	-
合计	80,250,273.83	2.84

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

### 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	600522	中天科技	8,190,512	184,040,804.64	6.51
2	300438	鹏辉能源	2,438,996	183,217,379.52	6.48
3	603185	上机数控	1,054,077	142,194,987.30	5.03
4	688120	华海清科	407,003	135,190,116.48	4.78
5	300750	宁德时代	316,831	127,014,379.59	4.49
6	600499	科达制造	7,481,700	125,243,658.00	4.43
7	002371	北方华创	437,911	121,914,422.40	4.31
8	603690	至纯科技	2,938,800	116,699,748.00	4.13
9	002050	三花智控	4,002,100	98,451,660.00	3.48
10	601869	长飞光纤	2,269,757	95,579,467.27	3.38

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	126,348,960.28	4.47
	其中：政策性金融债	126,348,960.28	4.47
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	126,348,960.28	4.47

#### 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	092118003	21 农发清发 03	700,000	70,744,512.33	2.50
2	220401	22 农发 01	300,000	30,319,619.18	1.07
3	220301	22 进出 01	250,000	25,284,828.77	0.89

#### 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

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

### 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。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

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	1,952,950.41
2	应收证券清算款	175,627,445.91
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	177,580,396.32

#### 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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方科技创新混合 A	南方科技创新混合 C
报告期期初基金份额总额	935,171,973.45	188,055,546.19
报告期期间基金总申购份额	101,011,390.98	12,833,440.09
减：报告期期间基金总赎回份额	58,845,243.45	8,817,858.48
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	977,338,120.98	192,071,127.80

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 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。

#### 7.2 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。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、《南方科技创新混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方科技创新混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、南方科技创新混合型证券投资基金 2022 年 3 季度报告原文。

### 9.2 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。

### 9.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>