

# 南方香港优选股票型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

## 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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
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	8
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.9 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合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
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	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§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	37
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	43
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 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
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.....	48
§10 重大事件揭示.....	48
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.....	49
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
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.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方香港优选股票型证券投资基金
基金简称	南方香港优选股票（QDII-LOF）
场内简称	南方香港 LOF
基金主代码	160125
交易代码	160125
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2015 年 5 月 13 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	190,286,489.92 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所

注：1、本基金转型日期为 2015 年 5 月 13 日，该日起南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）正式变更为南方香港优选股票型证券投资基金。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，积极挖掘香港证券市场上的主题性投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，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“自上而下”的分析策略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“自下而上”的策略，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	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
		秦一楠

	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-68121816
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	北京东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518017	100031
法定代表人		周易	谷澍

## 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	-	纽约梅隆银行股份有限公司
	英文	-	The Bank of New York Mellon Corporation
注册地址		-	225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
办公地址		-	225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
邮政编码		-	10286

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 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(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	870,402.40
本期利润	-28,476,232.94
加权平均基金份额本期利润	-0.1461
本期加权平均净值利润率	-13.73%
本期基金份额净值增长率	-13.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-91,298,984.89
期末可供分配基金份额利润	-0.4798
期末基金资产净值	181,276,150.83
期末基金份额净值	0.9526
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-21.45%

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、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

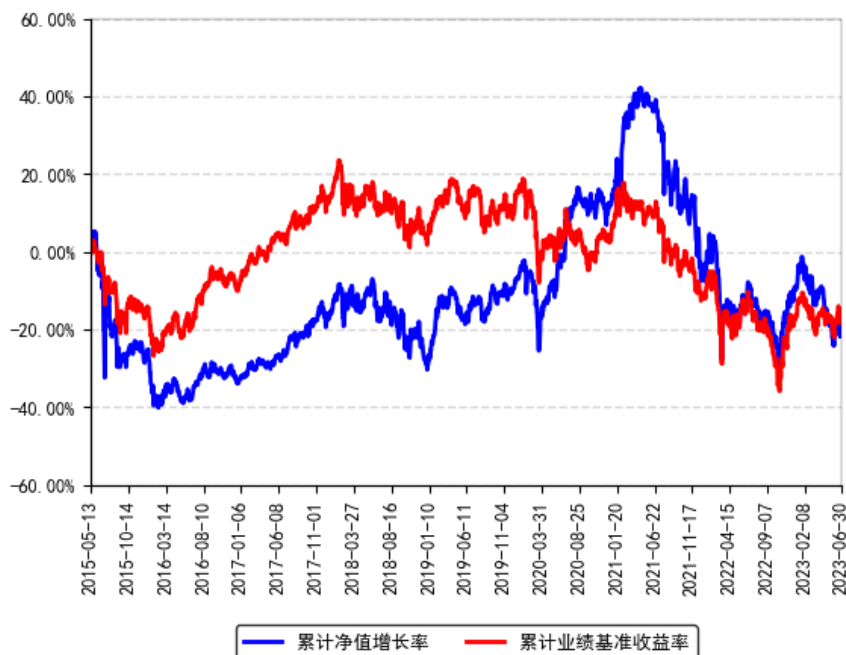
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.64%	1.37%	5.55%	1.30%	-1.91%	0.07%
过去三个月	-13.11%	1.29%	-2.20%	1.14%	-10.91%	0.15%
过去六个月	-13.67%	1.58%	-1.18%	1.26%	-12.49%	0.32%
过去一年	-14.27%	1.62%	-6.22%	1.55%	-8.05%	0.07%
过去三年	-20.16%	1.63%	-20.51%	1.44%	0.35%	0.19%

自基金合同生效起至今	-21.45%	1.55%	-17.68%	1.27%	-3.77%	0.28%
------------	---------	-------	---------	-------	--------	-------

### 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

南方香港优选股票（QDII-LOF）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，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。



南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

#### 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		
熊潇雅	本基金基金经理	2022 年 3 月 4 日	-	7 年	女，美国伊利诺伊大学厄巴纳香槟分校金融学硕士，具有基金从业资格。2015 年 7 月加入南方基金，历任国际业务部销售经理、研究员。2020 年 6 月 2 日至 2021 年 9 月 29 日，任投资经理助理；2021 年 9 月 29 日至今，任南方香港成长基金经理；2022 年 3 月 4 日至今，任南方香港优选基金经理。

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 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。

#### 4.4 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13次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

### 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

2023年上半年全球市场在疫情和俄乌冲突对供应链影响冲击逐步减退的背景下，能源价格调整，供应链问题逐步缓解，主要经济体通胀呈现回落态势，发达市场表现明显好于新兴市场。2023年1月至2023年6月发达市场 Markit 制造业月度 PMI 分别为 48.1、48.1、48.4、48.6、47.6 和 46.3，保持在荣枯线以上但呈现回落的趋势，其中美国 Markit 制造业月度 PMI 分别为 46.9、47.3、49.2、50.2、48.4 和 46.3；新兴市场 Markit 制造业月度 PMI 分别为 49.9、51.6、50.7、50.5、51.4 和 51.1，呈“M”型走势。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，2023年上半年 MSCI 全球价值指数上涨 2.5%，MSCI 全球成长指数上涨 26.5%。

报告期间，MSCI 全球指数按美元计价上涨 12.8%，MSCI 新兴市场指数按美元计价上涨 3.5%，恒生指数按港币计价下跌 4.4%，黄金价格按美元计价上涨 5.4%，十年期美国国债和十年期德国国债收益率分别上升 2 个基点和 7 个基点，十年期日本国债下跌 28 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 11.0%，印度 Nifty 指数按本币计价上涨 4.8%，俄罗斯 MOEX 指数按本币计价上涨 29.9%，美元指数下行，由 103.77 下跌至 102.92。

港股市场方面，2023年上半年恒生指数下跌 4.37%，恒生国企指数下跌 0.21%。从市值角度来看，恒生大型股指数下跌 8.21%，恒生中型股指数上涨 4.55%，恒生小型股指数上涨 50.44%。根据 Wind 统计，2023年上半年港股通南下资金累计净买入 1236 亿元人民币，第一季度净流入规模高于第二季度。恒生 AH 股溢价指数于报告期内小幅回落，由 137.84 点下降至 137.56 点。

港股市场来看,一季度主要指数都有小幅的上涨主要对疫情放开后经济表现的乐观预期,但是从二季度开始,实际恢复程度不及预期,市场迅速反应跌幅明显,但是从6月开始我们关注到市场的悲观预期逐步释放,前期回撤明显板块出现了明显的反弹,随着相关重要会议积极的内容的释放,市场开启了正面解读,顺周期板块开始有比较明显的反馈,市场情绪明显开始提升。我们当前关注当前我们更加关注具备政策刺激可能性,弹性较大,前期景气度较高但跌幅较深具备明显性价比的行业和公司。比如家居、家电、汽车,同时我们关注并看好一些具备明显变现能力和利润实现能力的 AI 公司,中期维度我们仍然看好新兴消费板块、科技包括医药板块的投资机会。

#### 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 0.9526 元,报告期内,份额净值增长率为-13.67%,同期业绩基准增长率为-1.18%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基于经济周期上行的修复力量,我们对港股充满信心,从历史上我们也看到港股估值较低的时期,下一个基钦周期中往往会有更好的表现。我们坚信科技与消费是中国未来经济增长的重要力量,随着这些行业在港股的比重越来越重,投资港股相当于投资中国经济的未来。港股作为离岸市场,受到海外市场环境的影响确实更加明显,特别是美国的加息周期尚未结束,港股在过去的半年受到了明显的压制。但是我们也看到内资进入港股市场的信心,外资对于港股的预期已经很低,这些因素将伴随着经济周期的逐步上行带动港股逐步修复。

资产配置上,基金在维持行业均衡配置的前提下,整体仓位维持平稳,主要通过自下而上的选股获取超额收益,并通过自上而下的行业研究及宏观研究进行配置决策。在投资策略上以价值投资为导向,遵循自下而上为主的原则,在行业中精选盈利改善、估值水平合理的行业龙头公司,尤其关注公司的技术优势、发展战略、行业成长性以及产业政策的变化。基金围绕港股市场估值体系重构的长期逻辑进行个股筛选,不断发掘存在估值重估机会的细分行业和个股,同时通过分散化投资控制投资组合整体的风险。本基金在配置过程中也兼顾流动性、市场风格转换及调仓成本等其他相关因素,努力控制基金的回撤水平,力争战胜业绩比较基准,为投资者创造持续稳健的投资回报。

#### 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、固定收益研究部总经

理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、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

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

#### 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：南方香港优选股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	18,793,492.23	24,733,208.66
结算备付金		-	-
存出保证金		119,995.70	116,259.09
交易性金融资产	6.4.3.2	167,513,961.02	201,099,935.11
其中：股票投资		167,513,961.02	192,183,211.42
基金投资		-	8,916,723.69
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
债权投资	6.4.3.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.3.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.3.7	-	-
应收清算款		-	3,036,517.33
应收股利		694,606.60	10,361.93
应收申购款		158,844.35	281,127.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.8	-	-
资产总计		187,280,899.90	229,277,409.67

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		-	-
应付清算款		4,887,288.09	-
应付赎回款		737,046.54	1,118,987.29
应付管理人报酬		243,000.09	303,908.72
应付托管费		45,562.51	56,982.87
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.9	91,851.84	1,020,337.55
负债合计		6,004,749.07	2,500,216.43
净资产：			
实收基金	6.4.3.10	190,286,489.92	205,499,615.42
其他综合收益	6.4.3.11	-	-
未分配利润	6.4.3.12	-9,010,339.09	21,277,577.82
净资产合计		181,276,150.83	226,777,193.24
负债和净资产总计		187,280,899.90	229,277,409.67

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9526 元，基金份额总额 190,286,489.92 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方香港优选股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-26,387,235.42	-21,898,255.73
1.利息收入		9,085.76	23,752.95
其中：存款利息收入	6.4.3.13	9,085.76	23,493.22
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			
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	259.73
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,572,717.50	-149,101,692.06
其中：股票投资收益	6.4.3.14	935,888.41	-152,381,512.10
基金投资收益	6.4.3.15	-858,126.46	-
债券投资收益	6.4.3.16	-	-
资产支持证券投资	6.4.3.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.3.18	-	-
衍生工具收益	6.4.3.19	-	-
股利收益	6.4.3.20	2,494,955.55	3,279,820.04
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.21	-29,346,635.34	125,542,832.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		343,379.45	1,513,809.75
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.22	34,217.21	123,041.52
减：二、营业总支出		2,088,997.52	2,683,563.09
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	1,655,926.72	2,163,688.32
2.托管费	6.4.6.2.2	310,486.23	405,691.53
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.3.23	-	-
7.税金及附加		8,312.43	-
8.其他费用	6.4.3.24	114,272.14	114,183.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-28,476,232.94	-24,581,818.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-28,476,232.94	-24,581,818.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-28,476,232.94	-24,581,818.82

## 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方香港优选股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	205,499,615.42	-	21,277,577.82	226,777,193.24
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	205,499,615.42	-	21,277,577.82	226,777,193.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,213,125.50	-	-30,287,916.91	-45,501,042.41
（一）、综合收益总额	-	-	-28,476,232.94	-28,476,232.94
（二）、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）	-15,213,125.50	-	-1,811,683.97	-17,024,809.47
其中：1.基金申购款	17,427,992.99	-	1,317,816.20	18,745,809.19
2.基金赎回款	-32,641,118.49	-	-3,129,500.17	-35,770,618.66
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	190,286,489.92	-	-9,010,339.09	181,276,150.83
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计



一、上期期末净资产(基金净值)	273,142,418.78	-	47,785,575.76	320,927,994.54
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	273,142,418.78	-	47,785,575.76	320,927,994.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-59,733,173.36	-	-24,079,650.19	-83,812,823.55
(一)、综合收益总额	-	-	-24,581,818.82	-24,581,818.82
(二)、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)	-59,733,173.36	-	502,168.63	-59,231,004.73
其中：1.基金申购款	57,512,213.12	-	6,093,338.92	63,605,552.04
2.基金赎回款	-117,245,386.48	-	-5,591,170.29	-122,836,556.77
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	213,409,245.42	-	23,705,925.57	237,115,170.99

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 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。

### 6.4.2.2 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。

### 6.4.2.3 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。

## 6.4.3 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	18,793,492.23
等于：本金	18,793,049.84
加：应计利息	442.39
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	18,793,492.23

注：货币资金中包括以下外币余额：

项目	本期末		
	2023 年 6 月 30 日		
	外币金额	汇率	折合人民币
港元	17,928,654.51	0.92198	16,529,860.88
美元	25,536.54	7.2258	184,521.93
合计			16,714,382.81

### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	166,553,676.07	-	167,513,961.02	960,284.95
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	166,553,676.07	-	167,513,961.02	960,284.95

### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.3.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 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 债权投资

#### 6.4.3.5.1 债权投资情况

无。

#### 6.4.3.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.3.6 其他债权投资

##### 6.4.3.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 6.4.3.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.3.7 其他权益工具投资

##### 6.4.3.7.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.3.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

#### 6.4.3.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.3.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,071.39
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
其他	-
合计	91,851.84

#### 6.4.3.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	205,499,615.42	205,499,615.42
本期申购	17,427,992.99	17,427,992.99
本期赎回（以“-”号填列）	-32,641,118.49	-32,641,118.49
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	190,286,489.92	190,286,489.92

本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.3.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.3.12 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	-98,928,698.25	120,206,276.07	21,277,577.82
本期利润	870,402.40	-29,346,635.34	-28,476,232.94
本期基金份额交易产生的变动数	6,759,310.96	-8,570,994.93	-1,811,683.97
其中：基金申购款	-7,808,934.39	9,126,750.59	1,317,816.20
基金赎回款	14,568,245.35	-17,697,745.52	-3,129,500.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-91,298,984.89	82,288,645.80	-9,010,339.09

#### 6.4.3.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,925.81
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	-
其他	159.95
合计	9,085.76

#### 6.4.3.14 股票投资收益

##### 6.4.3.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	935,888.41
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	935,888.41

##### 6.4.3.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	204,392,985.08
减：卖出股票成本总额	202,303,944.78
减：交易费用	1,153,151.89
买卖股票差价收入	935,888.41

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

#### 6.4.3.14.3 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。

#### 6.4.3.14.4 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。

#### 6.4.3.14.5 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。

#### 6.4.3.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	19,615,309.27
减：卖出/赎回基金成本总额	20,362,690.77
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	69,270.20
减：交易费用	41,474.76
基金投资收益	-858,126.46

注：上述交易费用（如有）包含基金买卖或申赎产生的交易费用。

#### 6.4.3.16 债券投资收益

##### 6.4.3.16.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.3.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

#### 6.4.3.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.3.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.3.18 贵金属投资收益

##### 6.4.3.18.1 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。

### 6.4.3.19 衍生工具收益

#### 6.4.3.19.1 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。

#### 6.4.3.19.2 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。

### 6.4.3.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,494,955.55
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	2,494,955.55

### 6.4.3.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-29,346,635.34
——股票投资	-27,497,792.68
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-1,848,842.66
——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	-29,346,635.34

### 6.4.3.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	34,217.21
合计	34,217.21

注：本基金场内部分的赎回费率为 0.50%，场外部分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。

### 6.4.3.23 信用减值损失

无。

### 6.4.3.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	27,491.69
合计	114,272.14

### 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

### 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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人、基金销售机构
纽约梅隆银行股份有限公司("纽约梅隆银行")	境外资产托管人
华泰金融控股(香港)有限公司("华泰香港")	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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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



华泰香港	231,807,076.21	56.77%	166,239,242.90	14.09%
------	----------------	--------	----------------	--------

#### 6.4.6.1.2 债券交易

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债券交易。

#### 6.4.6.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

#### 6.4.6.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰香港	19,206,224.82	58.36%	-	-

#### 6.4.6.1.5 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。

#### 6.4.6.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
华泰香港	301,215.97	48.32%	-	-
华泰证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
华泰香港	199,487.13	15.38%	-	-
华泰证券	-	-	948,676.52	97.65%

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管	1,655,926.72	2,163,688.32

理费		
其中：支付销售机构的客户 维护费	437,639.97	500,214.82

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的 1.60% 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 × 1.60% / 当年天数。

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	310,486.23	405,691.53

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
纽约梅隆银行	16,893,188.60	2,060.55	31,894,473.80	20.87
中国农业银行	1,900,303.63	6,865.26	1,992,800.97	23,472.35

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司和境外托管人纽约梅隆银行股份有限公司保管，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**

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。

**6.4.6.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.7 利润分配情况****6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.8 期末（2023 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**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
1698 HK	博士蛙国际	2012/3/15	已退市	0.15	不适用	不适用	44,000.00	74,335.78	6,734.14	-
67 HK	旭光高新	2014/3/25	重大事项	0.01	未知	未知	2,950.00	134,203.06	27.20	-
1228 HK	奇峰国际	2014/11/20	已退市	-	不适用	不适用	110,000.00	32,822.22	1.01	-
2468	创益	2012/6/20	已退	-	不适	不适用	39,000.00	44,553.93	0.00	-

HK	太阳能控股有限公司		市		用					
773 HK	中国金属再生资源	2013/1/28	已退市	-	不适用	不适用	50,000.00	291,930.06	0.00	-

### 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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.9 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.9.1 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农业银行及境外资产托管人纽约梅隆银行，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 2023 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.9.2 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 2023 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(净资产)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。

#### 6.4.9.2.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金本报告期末及上年度末无金融资产和金融负债的到期期限分析。

#### 6.4.9.2.2 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期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 2023 年 6 月 30 日,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.004%。

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。

#### 6.4.9.3 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。

##### 6.4.9.3.1 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、存出保证金和应收申购款等。

#### 6.4.9.3.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	2,084,067.86	-	-	16,709,424.37	18,793,492.23
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	119,995.70	-	-	-	119,995.70
交易性金融资产	-	-	-	167,513,961.02	167,513,961.02
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	694,606.60	694,606.60
应收申购款	18,151.62	-	-	140,692.73	158,844.35
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,222,215.18	-	-	185,058,684.72	187,280,899.90
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金	-	-	-	-	-

融资产款					
应付清算款	-	-	-	4,887,288.09	4,887,288.09
应付赎回款	-	-	-	737,046.54	737,046.54
应付管理人报酬	-	-	-	243,000.09	243,000.09
应付托管费	-	-	-	45,562.51	45,562.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	91,851.84	91,851.84
负债总计	-	-	-	6,004,749.07	6,004,749.07
利率敏感度缺口	2,222,215.18	-	-	179,053,935.65	181,276,150.83
上年度末 2022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	1,939,538.70	-	-	22,793,669.96	24,733,208.66
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	116,259.09	116,259.09
交易性金融资产	-	-	-	201,099,935.11	201,099,935.11
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	3,036,517.33	3,036,517.33
应收股利	-	-	-	10,361.93	10,361.93
应收申购款	12,066.87	-	-	269,060.68	281,127.55
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-



资产总计	1,951,605.57	-	-	227,325,804.10	229,277,409.67
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,118,987.29	1,118,987.29
应付管理人报酬	-	-	-	303,908.72	303,908.72
应付托管费	-	-	-	56,982.87	56,982.87
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,020,337.55	1,020,337.55
负债总计	-	-	-	2,500,216.43	2,500,216.43
利率敏感度缺口	1,951,605.57	-	-	224,825,587.67	226,777,193.24

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。

#### 6.4.9.3.1.2 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(2023年6月30日)	上年度末(2022年12月31日)
	1.市场利率平行上升25个基点	0.00	0.00
2.市场利率平行下降25个基点	0.00	0.00	

#### 6.4.9.3.2 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。

#### 6.4.9.3.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	184,521.93	16,529,860.88	-	-	-	16,714,382.81
存出保证金	-	119,995.70	-	-	-	119,995.70
交易性金融资产	-	167,513,961.02	-	-	-	167,513,961.02
应收股利	-	694,606.60	-	-	-	694,606.60
资产合计	184,521.93	184,858,424.20	-	-	-	185,042,946.13
以外币计价的负债						
应付清算款	-	4,887,288.09	-	-	-	4,887,288.09
负债合计	-	4,887,288.09	-	-	-	4,887,288.09
资产负债表外汇风险敞口净额	184,521.93	179,971,136.11	-	-	-	180,155,658.04

项目	上年度末 2022 年 12 月 31 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	203,426.57	22,616,105.33	-	-	-	22,819,531.90
存出保证金	-	116,259.09	-	-	-	116,259.09
交易性金融资产	-	201,099,935.11	-	-	-	201,099,935.11
应收股利	-	10,361.93	-	-	-	10,361.93
应收清算款	-	3,036,517.33	-	-	-	3,036,517.33
资产合计	203,426.57	226,879,178.79	-	-	-	227,082,605.36
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	203,426.57	226,879,178.79	-	-	-	227,082,605.36

#### 6.4.9.3.2.2 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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	9,007,782.90	11,354,130.27
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-9,007,782.90	-11,354,130.27	

#### 6.4.9.3.3 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，采用“自上而下”的策略，通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整各类资产的比例，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票（普通股、优先股）的基金资产占基金资产总值的比例为 80%-95%；其余基金资产投资于存托凭证、房地产信托凭证、公募基金、金融衍生产品、结构性投资产品、货币市场工具、其它固定收益产品以及相关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具，其占基金资产总值的比例为 5%-20%。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。

#### 6.4.9.3.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	167,513,961.02	92.41	192,183,211.42	84.75
交易性金融资产-基金投资	-	-	8,916,723.69	3.93
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	167,513,961.02	92.41	201,099,935.11	88.68

#### 6.4.9.3.2 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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	8,293,561.89	10,840,067.66
	2.组合自身基准下降 5%	-8,293,561.89	-10,840,067.66

### 6.4.10 公允价值

#### 6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	167,507,198.67
第二层次	-
第三层次	6,762.35
合计	167,513,961.02

##### 6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.11 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	167,513,961.02	89.45
	其中：普通股	167,513,961.02	89.45
	存托凭证	-	-
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	18,793,492.23	10.03
8	其他资产	973,446.65	0.52
9	合计	187,280,899.90	100.00

## 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（%）
中国香港	167,513,961.02	92.41
合计	167,513,961.02	92.41

## 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	3,810,358.94	2.10
材料	3,627,097.53	2.00
工业	1,873,352.72	1.03
非必需消费品	44,771,662.73	24.70
必需消费品	20,246,892.13	11.17
医疗保健	30,450,731.33	16.80
金融	15,032,496.67	8.29
科技	1,843,222.42	1.02
通讯	43,568,999.29	24.03
公用事业	-	-
房地产	2,289,147.26	1.26
政府	-	-
合计	167,513,961.02	92.41

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	Tencent Holding s Ltd	腾讯控股有限公司	0700 HK	中国香港联合交易所	中国香港	43,700	13,360,338.42	7.37
2	Hong Kong	香港交易及结	0388 HK	中国香港联合	中国香港	45,400	12,356,449.72	6.82

	Exchanges and Clearing Ltd.	算所有有限公司		交易所				
3	China Mobile Limited	中国移动有限公司	0941 HK	中国香港联合交易所	中国香港	130,100	7,682,771.75	4.24
4	Miniso Group Holding Limited	名创优品集团控股有限公司	9896 HK	中国香港联合交易所	中国香港	249,600	7,605,671.17	4.20
5	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	179,650	7,022,869.18	3.87
6	Li Auto Inc.	理想汽车	2015 HK	中国香港联合交易所	中国香港	53,800	6,721,142.00	3.71
7	Gushengtang Holdings Limited	固生堂控股有限公司	2273 HK	中国香港联合交易所	中国香港	140,400	6,433,465.80	3.55
8	Pop Mart International Group Limited	泡泡玛特国际集团有限公司	9992 HK	中国香港联合交易所	中国香港	379,600	6,096,714.45	3.36
9	Chongqing Hongjiu Fruit Co., Limited	重庆洪九果品股份有限公司	6689 HK	中国香港联合交易所	中国香港	369,100	6,084,614.39	3.36
10	Kingsoft Corporation Limited	金山软件有限公司	3888 HK	中国香港联合交易所	中国香港	168,600	4,795,503.79	2.65
11	Sisram Medical	复锐医疗科技	1696 HK	中国香港联合交易所	中国香港	545,000	4,693,154.79	2.59

	Ltd	有限公司		交易所				
12	Beauty Farm Medical And Health Industry Inc.	美丽田园医疗健康产业有限公司	2373 HK	中国香港联合交易所	中国香港	212,000	4,632,396.31	2.56
13	Shanghai Haohai Biological Technology Co.,Ltd	上海昊海生物科技股份有限公司	6826 HK	中国香港联合交易所	中国香港	156,600	4,620,226.18	2.55
14	Giant Biogene Holding Co., Ltd	巨子生物控股有限公司	2367 HK	中国香港联合交易所	中国香港	136,530	4,380,551.94	2.42
15	XPeng Inc.	小鹏汽车有限公司	9868 HK	中国香港联合交易所	中国香港	83,500	3,849,266.50	2.12
16	Cnooc Limited	中国海洋石油有限公司	0883 HK	中国香港联合交易所	中国香港	369,000	3,810,358.94	2.10
17	Meitu, Inc.	美图公司	1357 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,387,000	3,785,207.33	2.09
18	China Resources Beer (Holdings) Company Limited	华润啤酒(控股)有限公司	0291 HK	中国香港联合交易所	中国香港	78,917	3,754,410.62	2.07
19	H World Group Limited	华住集团有限公司	1179 HK	中国香港联合交易所	中国香港	129,000	3,597,796.46	1.98
20	PRADA S.p.A.	PRADA S.p.A.	1913 HK	中国香港联合交易所	中国香港	72,600	3,514,126.77	1.94



				交易所				
21	Meituan	美团	3690 HK	中国香港联合交易所	中国香港	30,000	3,382,744.62	1.87
22	Kuaishou Technology	快手科技	1024 HK	中国香港联合交易所	中国香港	67,400	3,327,674.75	1.84
23	L'occitane International S.A.	L'occitane International S.A.	0973 HK	中国香港联合交易所	中国香港	186,000	3,230,839.20	1.78
24	Innovent Biologics, Inc.	信达生物制药	1801 HK	中国香港联合交易所	中国香港	111,000	3,029,257.49	1.67
25	New Horizon Health Limited	诺辉健康	6606 HK	中国香港联合交易所	中国香港	111,000	2,798,992.98	1.54
26	Tsingtao Brewery Company Limited	青岛啤酒股份有限公司	0168 HK	中国香港联合交易所	中国香港	42,600	2,796,475.98	1.54
27	Hisense Home Appliances Group Co., Ltd.	海信家电集团股份有限公司	0921 HK	中国香港联合交易所	中国香港	150,000	2,779,769.70	1.53
28	Baidu, Inc.	百度集团股份有限公司	9888 HK	中国香港联合交易所	中国香港	20,600	2,522,242.25	1.39
29	China Literature Limited	阅文集团	0772 HK	中国香港联合交易所	中国香港	82,000	2,491,097.76	1.37
30	IGG Inc	IGG Inc	0799 HK	中国香港联合交易所	中国香港	678,000	2,425,397.47	1.34

				交易所				
31	Trip.com Group Limited	携程集团有限公司	9961 HK	中国香港联合交易所	中国香港	9,100	2,287,18.91	1.26
32	NIO Inc.	蔚来集团	9866 HK	中国香港联合交易所	中国香港	26,970	1,886,070.98	1.04
33	Morimatsu International Holdings Company Limited	森松国际控股有限公司	2155 HK	中国香港联合交易所	中国香港	316,000	1,873,352.72	1.03
34	Semiconductor Manufacturing International Corporation	中芯国际集成电路制造有限公司	0981 HK	中国香港联合交易所	中国香港	98,000	1,843,222.42	1.02
35	Zijin Mining Group Company Limited	紫金矿业集团股份有限公司	2899 HK	中国香港联合交易所	中国香港	172,000	1,823,676.44	1.01
36	Zhaojin Mining Industry Company Limited	招金矿业股份有限公司	1818 HK	中国香港联合交易所	中国香港	200,000	1,803,392.88	0.99
37	ESR Group Limited	ESR Group Limited	1821 HK	中国香港联合交易所	中国香港	140,000	1,734,797.57	0.96
38	CITIC Limited	中国中信股份有限公司	0267 HK	中国香港联合交易所	中国香港	200,000	1,724,102.60	0.95

39	Haier Smart Home Co., Ltd.	海尔智家股份有限公司	6690 HK	中国香港联合交易所	中国香港	70,000	1,590,876.49	0.88
40	Keymed Biosciences Inc.	康诺亚生物医药科技有限公司	2162 HK	中国香港联合交易所	中国香港	25,500	961,579.04	0.53
41	New China Life Insurance Company Ltd.	新华人寿保险股份有限公司	1336 HK	中国香港联合交易所	中国香港	50,000	951,944.35	0.53
42	BeiGene, Ltd.	百济神州有限公司	6160 HK	中国香港联合交易所	中国香港	9,000	891,185.87	0.49
43	Yuexiu Property Company Limited	越秀地产股份有限公司	0123 HK	中国香港联合交易所	中国香港	66,000	554,349.69	0.31
44	Boshiwala International Holding Ltd	博士蛙国际	1698 HK	中国香港联合交易所	中国香港	44,000	6,734.14	0.00
45	China Lumena New Materials Corp.	中国旭光高新材料集团有限公司	0067 HK	中国香港联合交易所	中国香港	2,950	27.20	0.00
46	Superb Summit International Group Ltd	奇峰国际	1228 HK	中国香港联合交易所	中国香港	110,000	1.01	0.00
47	China Metal	中国金属再生	0773 HK	中国香港联合交易所	中国香港	50,000	0.00	0.00

	Recycling Holding s Ltd	资源		交易所				
48	Trony Solar Holding s Co Ltd	创益太阳能	2468 HK	中国香港联合交易所	中国香港	39,000	0.00	0.00

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

## 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	Pop Mart International Group Limited	9992 HK	12,197,089.23	5.38
2	Beauty Farm Medical And Health Industry Inc.	2373 HK	9,190,552.75	4.05
3	Tencent Holdings Ltd	0700 HK	8,780,019.02	3.87
4	Sisram Medical Ltd	1696 HK	7,659,789.59	3.38
5	Shanghai Haohai Biological Technology Co.,Ltd	6826 HK	7,372,021.18	3.25
6	PRADA S.p.A.	1913 HK	7,120,015.10	3.14
7	Kuaishou Technology	1024 HK	6,885,739.04	3.04
8	Giant Biogene Holding Co., Ltd	2367 HK	6,695,385.33	2.95
9	Li Auto Inc.	2015 HK	6,330,631.29	2.79
10	IGG Inc	0799 HK	6,043,440.03	2.66
11	Nayuki Holdings Limited	2150 HK	5,502,504.02	2.43
12	Morimatsu International Holdings Company	2155 HK	5,402,985.26	2.38

	Limited			
13	Chongqing Hongjiu Fruit Co., Limited	6689 HK	5,094,885.38	2.25
14	China Mobile Limited	0941 HK	4,883,171.16	2.15
15	Kingsoft Corporation Limited	3888 HK	4,645,521.53	2.05
16	H World Group Limited	1179 HK	4,547,096.81	2.01
17	Baidu, Inc.	9888 HK	4,409,834.51	1.94
18	XPeng Inc.	9868 HK	4,033,546.36	1.78
19	Meituan	3690 HK	3,996,672.91	1.76
20	Meitu, Inc.	1357 HK	3,908,102.10	1.72

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	Meituan	3690 HK	14,254,478.79	6.29
2	Chongqing Hongjiu Fruit Co., Limited	6689 HK	13,316,839.58	5.87
3	East Buy Holding Limited	1797 HK	12,386,323.35	5.46
4	Giant Biogene Holding Co., Ltd	2367 HK	8,867,620.67	3.91
5	China Overseas Property Holdings Limited	2669 HK	7,287,244.42	3.21
6	JD.Com, Inc.	9618 HK	7,237,678.28	3.19
7	China Mobile Limited	0941 HK	7,228,768.47	3.19
8	Fuyao Glass Industry Group Co.,Ltd.	3606 HK	6,236,985.80	2.75
9	Nayuki Holdings Limited	2150 HK	5,684,274.79	2.51
10	Brilliance China Automotive	1114 HK	5,288,680.01	2.33

	Holdings Ltd.			
11	Haier Smart Home Co., Ltd.	6690 HK	4,622,727.14	2.04
12	H World Group Limited	1179 HK	4,605,471.30	2.03
13	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	4,312,174.29	1.90
14	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	2319 HK	4,132,829.34	1.82
15	China Resources Mixc Lifestyle Services Limited	1209 HK	4,118,436.55	1.82
16	Pop Mart International Group Limited	9992 HK	3,653,796.50	1.61
17	PRADA S.p.A.	1913 HK	3,615,600.44	1.59
18	ENN Energy Holdings Limited	2688 HK	3,474,078.62	1.53
19	Beauty Farm Medical And Health Industry Inc.	2373 HK	3,443,501.12	1.52
20	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	3,373,604.86	1.49

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	203,966,306.12
卖出收入（成交）总额	204,392,985.08

### 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 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

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。

### 7.11.2 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	119,995.70
2	应收清算款	-
3	应收股利	694,606.60
4	应收利息	-
5	应收申购款	158,844.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	973,446.65

### 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
24,700	7,703.91	4,007,210.30	2.11%	186,279,279.62	97.89%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	左群	545,634.00	5.27%
2	罗远芬	380,000.00	3.67%
3	王安民	310,000.00	2.99%
4	王剑鹏	300,245.00	2.90%
5	唐亮	260,400.00	2.52%
6	李元生	233,055.00	2.25%
7	黄锦永	200,000.00	1.93%
8	杨凯	185,186.00	1.79%
9	顾少华	182,703.00	1.77%
10	吴燕	180,000.00	1.74%

### 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	1,898,443.46	0.9977%

### 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、基金投资和研究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	0



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年5月13日)基金份额总额	2,292,367,534.76
本报告期期初基金份额总额	205,499,615.42
本报告期基金总申购份额	17,427,992.99
减：报告期基金总赎回份额	32,641,118.49
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	190,286,489.92

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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，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	
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	231,807,076.21	56.77%	301,215.97	48.32%	-
UBS Securities Asia Limited	-	55,653,357.86	13.63%	55,653.33	8.93%	-
Haitong International Securities Co.,Ltd	-	30,676,376.00	7.51%	33,574.87	5.39%	-
BOCI Securities Limited	-	22,622,342.14	5.54%	23,797.47	3.82%	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	21,134,061.15	5.18%	122,455.01	19.64%	-
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	-	14,500,165.67	3.55%	39,062.35	6.27%	-
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	13,949,815.52	3.42%	13,949.82	2.24%	-

China Renaissance Securities (HK) Limited	-	8,342,230.82	2.04%	8,342.25	1.34%	-
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	-	6,400,475.69	1.57%	9,600.72	1.54%	-
GuangFa Securities (Hong Kong) Business Limited	-	3,273,390.14	0.80%	15,730.69	2.52%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	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。

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

东方证券

东兴证券

瑞信方正

英大证券

中金公司

中泰证券

中天证券

退租交易单元：

无

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	19,206,224.82	58.36%
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Co.,Ltd	-	-	-	-	-	-	2,898,473.91	8.81%
BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-	1,175,131.62	3.57%

China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
China Renaissance Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities (HK)Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
GuangFa Securities (Hong Kong)Business Limited	-	-	-	-	-	-	9,630,288.62	29.26%	
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-

## 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	关于南方香港优选股票型证券投资基金 2023 年 4 月 7 日、4 月 10 日暂停申购、赎回和定投业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-03
2	关于南方香港优选股票型证券投资基金 2023 年 5 月 26 日暂停申购、赎回和定投业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-23

## § 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优选股票型证券投资基金的文件；
- 2、《南方香港优选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方香港优选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、《南方香港优选股票型证券投资基金 2023 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>