

南方君誉混合型证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	56

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
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.....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方君誉混合型证券投资基金	
基金简称	南方君誉混合	
基金主代码	016676	
交易代码	016676	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 15 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	194,791,568.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方君誉混合 A	南方君誉混合 C
下属分级基金的交易代码	016676	016677
报告期末下属分级基金的份 额总额	170,854,020.28 份	23,937,547.73 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，投资于精选的股票，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、金融衍生品投资策略；5、资产支持证券投资策略
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×45%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+上证国债指数收益率×45%
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的收益低于股票型基金，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。

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	交通银行股份有限公司
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	95559

传真	0755-82763889	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518017	200336
法定代表人	周易	任德奇

2.4 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	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、南方君誉混合 A

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	6,393,704.01
本期利润	6,399,208.88
加权平均基金份额本期利润	0.0258
本期加权平均净值利润率	2.56%
本期基金份额净值增长率	0.87%
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	887,536.08
期末可供分配基金份额利润	0.0051
期末基金资产净值	171,741,556.36
期末基金份额净值	1.0052
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	0.52%

2、南方君誉混合 C

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	778,005.25
本期利润	1,175,943.49
加权平均基金份额本期利润	0.0311
本期加权平均净值利润率	3.09%
本期基金份额净值增长率	0.56%
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	33,916.33
期末可供分配基金份额利润	0.0014
期末基金资产净值	23,971,464.06
期末基金份额净值	1.0014
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	0.14%

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

南方君誉混合 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
过去一个月	0.72%	0.71%	1.25%	0.48%	-0.53%	0.23%
过去三个月	-0.45%	0.64%	-1.79%	0.45%	1.34%	0.19%
过去六个月	0.87%	0.56%	0.62%	0.46%	0.25%	0.10%
自基金合同生效起至今	0.52%	0.49%	1.45%	0.47%	-0.93%	0.02%

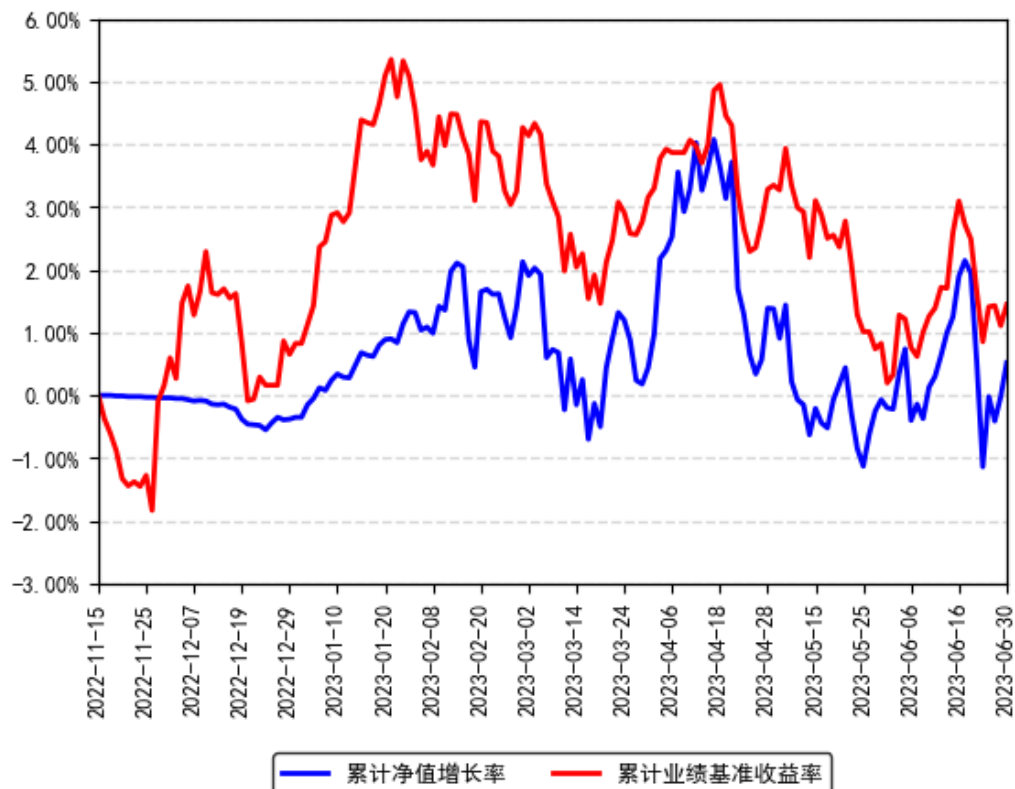
南方君誉混合 C

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
过去一个月	0.67%	0.71%	1.25%	0.48%	-0.58%	0.23%
过去三个月	-0.60%	0.64%	-1.79%	0.45%	1.19%	0.19%

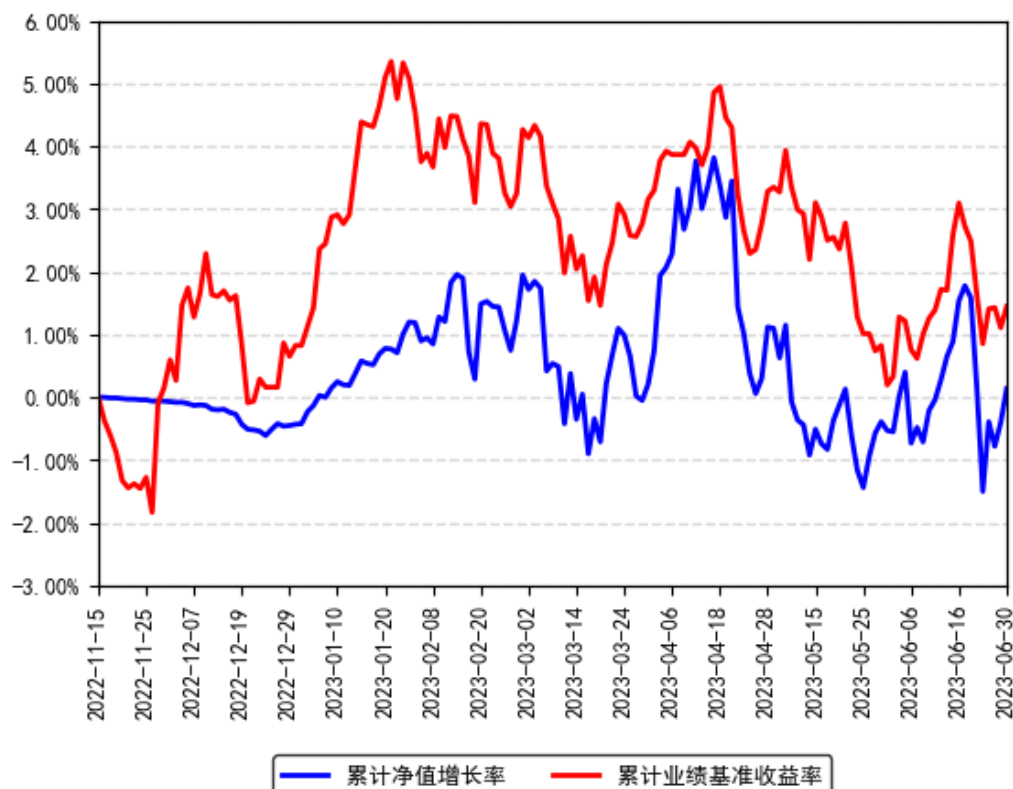
过去六个月	0.56%	0.56%	0.62%	0.46%	-0.06%	0.10%
自基金合同生效起至今	0.14%	0.49%	1.45%	0.47%	-1.31%	0.02%

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

南方君誉混合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



南方君誉混合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



注：本基金合同于 2022 年 11 月 15 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，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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		
卢玉珊	本基金基金经理	2022年11月15日	-	14年	女，清华大学会计学硕士，具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金，历任研究部研究员、高级研究员，负责纺织服装、商贸零售的行业研究工作；2015年2月26日至2015年12月30日，任南方成份、南方安心的基金经理助理；2015年5月19日至2015年12月30日，任南方改革机遇的基金经理助理；2015年12月30日至2019年1月9日，任南方安心基金经理；2019年1月9日至今，任南方核心竞争混合基金经理；2019年1月25日至今，任南方改革机遇基金经理；2020年5月15日至今，任南方君选基金经理；2021年6月21日至今，任南方价值臻选混合基金经理；2022年2月7日至今，任南方比较优势混合基金经理；2022年9月14日至今，任南方鑫悦15个月持有混合基金经理；2022年11月15日至今，任南方君誉混合基金经理。

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最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年，wind 全 A 上涨 3.06%，上证指数上涨 3.65%，深证成指上涨 0.10%，创业板指下跌 5.61%，沪深 300 下跌 0.75%。TMT 板块受到数字经济政策和 AIGC 产品的持续催化表现亮眼，通信、传媒、计算机分别上涨 50.66%、42.75% 和 27.57%。受经济复苏低于预期影响，地产、建材、农林牧渔、食品饮料、化工、交运等偏顺周期板块跌幅较大。

我们略微跑赢了业绩基准。操作上我们减持了部分新能源、食品饮料，加仓了高股息品种、TMT、医药和出口弹性较大的制造业，总体调仓产生了一定的正贡献，比较遗憾的 TMT 的选股不够聚焦，传媒和通信的超额收益被计算机选股的亏损对冲。我们将在后续的投资中提高对个股的甄别，适度提高股票集中度。

4.4.2 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 1.0052 元，报告期内，份额净值增长率为 0.87%，同期业绩基准增长率为 0.62%；本基金 C 份额净值为 1.0014 元，报告期内，份额净值增长率为 0.56%，同期业绩基准增长率为 0.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观角度来看，当期经济处于旺季不旺、上行动能不足的状态，目前处于宏观周期明显的底部状态。相比于 2022 年，我们没有看到进一步走弱，但同时向上趋势也未形成。当前 A 股整体估值无论是相对自身历史，还是相对债券，均处于相对低估状态，以年度为展望，值得积极配置。从市场风险偏好和流动性角度来看，当前市场换手率依然较低，场外资金除北向交易型资金相对活跃外，公募基金发行、两融、绝对收益类产品，均处于活跃度比较低的状态，所以无论从估值还是流动性的角度，当前时点看未来一年，权益类资产仍是性价比

较高的选择。中期来看，当前股息率与未来 1-2 年沪深 300 股息股呈现强正相关，当前股息率情况下，未来两年内亏钱概率较低。

A 股在宏观经济增速重回 L 型背景下，我们重点关注两方面的机会：一是供给需求双刚性的线索，寻找盈利稳定抗通胀抗衰退资产，一是寻找渗透率低、政策扶植的战略新兴产业。

展望后市，我们主要关注三条投资主线：

一是中国特色估值体系，低估值高股息央国企的估值重估机会。包括运营商、能源、基建在内。

二是数字经济对经济高质量发展的重要性，以及 AI 带来的新一轮科技革命。以计算机、通信、传媒为代表。

三是科创板，在自主可控安全方向上的战略意义。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、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。

4.7 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。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在南方君誉混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，南方基金管理股份有限公司在南方君誉混合型证券投资基金投资运作、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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由南方基金管理股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关南方君誉混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：南方君誉混合型证券投资基金

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	6.4.7.1	31,782,012.58	13,730,596.22
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	157,571,008.64	65,199,127.13
其中：股票投资		137,050,909.55	44,983,203.92
基金投资		-	-
债券投资		20,520,099.09	20,215,923.21
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	17,000,017.00	409,881,724.55
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		105,440.51	-
应收申购款		100,123.92	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		206,558,602.65	488,811,447.90
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		271,165.23	-
应付管理人报酬		252,896.36	622,450.23
应付托管费		42,149.37	103,741.71
应付销售服务费		12,745.60	37,588.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	10,266,625.33	175.00
负债合计		10,845,582.23	763,955.74
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	194,791,568.01	489,803,479.73
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	921,452.41	-1,755,987.57
净资产合计		195,713,020.42	488,047,492.16
负债和净资产总计		206,558,602.65	488,811,447.90

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，南方君誉混合 A 份额净值 1.0052 元，基金份额总额 170,854,020.28 份；南方君誉混合 C 份额净值 1.0014 元，基金份额总额 23,937,547.73 份；总份额合计 194,791,568.01 份。

6.2 利润表

会计主体：南方君誉混合型证券投资基金

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
一、营业总收入		10,345,146.38
1.利息收入		1,186,536.32
其中：存款利息收入	6.4.7.9	136,135.00
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		1,050,401.32
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,849,283.72
其中：股票投资收益	6.4.7.10	6,059,288.00
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	281,522.79
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	1,508,472.93
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）	6.4.7.14	403,443.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	905,883.23
减：二、营业总支出		2,769,994.01
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	2,193,476.16
2.托管费	6.4.10.2.2	365,579.30

3.销售服务费	6.4.10.2.3	117,053.24
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		-
7.税金及附加		0.12
8.其他费用	6.4.7.16	93,885.19
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		7,575,152.37
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		7,575,152.37
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		7,575,152.37

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体: 南方君誉混合型证券投资基金

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)	489,803,479.73	-	-1,755,987.57	488,047,492.16
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)	489,803,479.73	-	-1,755,987.57	488,047,492.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-295,011,911.72	-	2,677,439.98	-292,334,471.74
(一)、综合收益总额	-	-	7,575,152.37	7,575,152.37
(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)	-295,011,911.72	-	-4,897,712.39	-299,909,624.11
其中: 1.基金申购款	77,650,495.04	-	1,595,868.47	79,246,363.51

2.基金赎回款	-372,662,406.76	-	-6,493,580.86	-379,155,987.62
(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)	194,791,568.01	-	921,452.41	195,713,020.42

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 基金基本情况

南方君誉混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]1708号《关于准予南方君誉混合型证券投资基金注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方君誉混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集489,734,004.61元,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(22)第00543号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方君誉混合型证券投资基金基金合同》于2022年11月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为489,803,479.73份,其中认购资金利息折合69,475.12份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用、不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方君誉混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票以及存托凭证(下同))、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(简称“港股通股票”)、债券(包括国内依法发行的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为：本基金股票(含存托凭证)、可转换债券和可交换债券投资合计占基金资产的比例范围为 30%-80%(其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%)。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×45%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+上证国债指数收益率×45%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重

大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的金额确认，逐日确认债券利息并计入投资收益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息并计入投资收益。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息并记入投资收益。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券投资收益。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除权(息)日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率在回购期内逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为同一类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中

基协发[2013]13号)相关规定,本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3)根据中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》,在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

(2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	16,882,032.03
等于：本金	16,878,075.60
加：应计利息	3,956.43
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	14,899,980.55
等于：本金	14,897,946.57
加：应计利息	2,033.98
减：坏账准备	-
合计	31,782,012.58

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 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	138,160,601.54	-	137,050,909.55	-1,109,691.99	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	9,966,141.00	233,036.34	10,219,578.54	20,401.20
	银行间市场	10,062,330.00	274,520.55	10,300,520.55	-36,330.00
	合计	20,028,471.00	507,556.89	20,520,099.09	-15,928.80
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	158,189,072.54	507,556.89	157,571,008.64	-1,125,620.79	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	17,000,017.00	-
银行间市场	-	-
合计	17,000,017.00	-

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 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	474.77

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	84,302.56
其他	10,181,848.00
合计	10,266,625.33

注：其他为券结模式下该基金场内预收款。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方君誉混合 A		
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	415,826,354.57	415,826,354.57
本期申购	62,264,288.23	62,264,288.23
本期赎回（以“-”号填列）	-307,236,622.52	-307,236,622.52
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	170,854,020.28	170,854,020.28

南方君誉混合 C		
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	73,977,125.16	73,977,125.16
本期申购	15,386,206.81	15,386,206.81
本期赎回（以“-”号填列）	-65,425,784.24	-65,425,784.24
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	23,937,547.73	23,937,547.73

注：1. 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；

2. 本基金自 2022 年 10 月 24 日至 2022 年 11 月 11 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 489,734,004.61 元，折合为 489,734,004.61 份基金份额(其中 A 类基金份额 415,764,750.07 份，C 类基金份额 73,969,254.54 份)。根据《南方君誉混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 69,475.12 元

在本基金成立后，折合为 69,475.12 基金份额(其中 A 类基金份额 61,604.50 份，C 类基金份额 7,870.62 份)，划入基金份额持有人账户。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

南方君誉混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-145,250.88	-1,298,210.91	-1,443,461.79
本期利润	6,393,704.01	5,504.87	6,399,208.88
本期基金份额交易产生的变动数	-1,045,616.50	-3,022,594.51	-4,068,211.01
其中：基金申购款	1,114,622.84	193,491.61	1,308,114.45
基金赎回款	-2,160,239.34	-3,216,086.12	-5,376,325.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,202,836.63	-4,315,300.55	887,536.08

南方君誉混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-81,672.79	-230,852.99	-312,525.78
本期利润	778,005.25	397,938.24	1,175,943.49
本期基金份额交易产生的变动数	-60,112.58	-769,388.80	-829,501.38
其中：基金申购款	229,875.52	57,878.50	287,754.02
基金赎回款	-289,988.10	-827,267.30	-1,117,255.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	636,219.88	-602,303.55	33,916.33

6.4.7.9 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	81,704.16
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	54,430.84
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	136,135.00

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

卖出股票成交总额	149,186,480.72
减：卖出股票成本总额	142,655,095.31
减：交易费用	472,097.41
买卖股票差价收入	6,059,288.00

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	281,522.79
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	281,522.79

6.4.7.11.2 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。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 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。

6.4.7.12.2 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。

6.4.7.13 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	1,508,472.93
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,508,472.93

6.4.7.14 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	403,443.11
——股票投资	443,790.91
——债券投资	-40,347.80

——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	403,443.11

6.4.7.15 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	905,822.42
基金转换费收入	60.81
合计	905,883.23

6.4.7.16 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	4,500.00
银行费用	4,731.74
其他	350.89
合计	93,885.19

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

南方基金管理股份有限公司于 2023 年 7 月 8 日发布公告《南方基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，管理人决定自 2023 年 7 月 10 日起，调低本基金管理费率及托管费率并对基金合同有关条款进行修订。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
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
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	2,193,476.16
其中：支付销售机构的客户维护费	342,467.35

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	365,579.30

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方君誉混合 A	南方君誉混合 C	合计
华泰证券	-	8.95	8.95
交通银行	-	44,901.56	44,901.56
南方基金	-	976.38	976.38
合计	-	45,886.89	45,886.89

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.60%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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	
	期末余额	当期利息收入
交通银行-银行存款	16,882,032.03	81,704.16

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	688472	阿特斯	网下申购	9,181	101,909.10
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	2,568	83,511.36
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	3,712	77,655.04
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	2,508	48,153.60
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	网下申购	24,701	140,548.69

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 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。

6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新股未上市	55.00	55.00	1,043	57,365.00	57,365.00	-
001286	陕西能源	2023	6 个月	新股锁	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-

		年 3 月 31 日		定期						
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	19.86	18.06	1,247	24,765.42	22,520.82	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	11.10	17.04	919	10,200.90	15,659.76	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股锁 定期	29.60	71.42	207	6,127.20	14,783.94	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	23.60	64.67	226	5,333.60	14,615.42	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	5.69	5.41	2,471	14,059.99	13,368.11	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	76.80	107.9 5	114	8,755.20	12,306.30	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	37.88	29.49	408	15,455.04	12,031.92	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	12.68	22.31	494	6,263.92	11,021.14	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	9.26	18.59	590	5,463.40	10,968.10	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	32.52	42.37	257	8,357.64	10,889.09	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	152.3 8	135.9 7	75	11,428.50	10,197.75	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	135.8 0	120.4 1	80	10,864.00	9,632.80	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	23.80	32.84	288	6,854.40	9,457.92	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	26.74	40.68	222	5,936.28	9,030.96	-

688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	36.15	38.13	219	7,916.85	8,350.47	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	75.00	90.76	91	6,825.00	8,259.16	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	12.10	12.07	661	7,998.10	7,978.27	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	10.68	12.34	645	6,888.60	7,959.30	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	35.00	51.23	142	4,970.00	7,274.66	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	14.16	16.21	446	6,315.36	7,229.66	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	20.92	19.16	372	7,782.24	7,127.52	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	43.67	53.05	134	5,851.78	7,108.70	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	30.26	25.33	277	8,382.02	7,016.41	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	11.88	21.02	316	3,754.08	6,642.32	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	50.00	48.39	137	6,850.00	6,629.43	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁 定期	26.66	31.50	209	5,571.94	6,583.50	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	19.99	16.90	380	7,596.20	6,422.00	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	19.20	25.53	251	4,819.20	6,408.03	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月	6 个月	新股锁 定期	46.13	34.40	180	8,303.40	6,192.00	-

		28 日								
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	26.35	30.60	201	5,296.35	6,150.60	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	32.60	30.37	192	6,259.20	5,831.04	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	6.58	7.58	748	4,921.84	5,669.84	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	125.8 8	86.79	60	7,552.80	5,207.40	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	25.28	29.87	173	4,373.44	5,167.51	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	73.45	46.64	106	7,785.70	4,943.84	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	33.99	29.49	150	5,098.50	4,423.50	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	11.66	12.26	247	2,880.02	3,028.22	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	10.36	11.84	254	2,631.44	3,007.36	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	20.68	25.49	103	2,130.04	2,625.47	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	25.98	24.53	81	2,104.38	1,986.93	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	15.38	14.87	131	2,014.78	1,947.97	-
001367	海森药业	2023	6 个月	新股锁	44.48	39.48	47	2,090.56	1,855.56	-

		年 3 月 30 日		定期						
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期风险和收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限

制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度，根据质押品的资质确定质押率水平，持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额，并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 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	31,782,012.58	-	-	-	31,782,012.58
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	20,432,530.44	-	87,568.65	137,050,909.55	157,571,008.64
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	17,000,017.00	-	-	-	17,000,017.00
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	-	-	-	105,440.51	105,440.51
应收申购款	-	-	-	100,123.92	100,123.92
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	69,214,560.02	-	87,568.65	137,256,473.98	206,558,602.65
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	-	-	-	271,165.23	271,165.23
应付管理人报酬	-	-	-	252,896.36	252,896.36
应付托管费	-	-	-	42,149.37	42,149.37
应付销售服务费	-	-	-	12,745.60	12,745.60
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税	-	-	-	-	-

负债					
其他负债	-	-	-	10,266,625.33	10,266,625.33
负债总计	-	-	-	10,845,582.23	10,845,582.23
利率敏感度缺口	69,214,560.02	-	87,568.65	126,410,891.75	195,713,020.42
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	13,730,596.22	-	-	-	13,730,596.22
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	20,215,923.21	-	-	44,983,203.92	65,199,127.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	409,881,724.55	-	-	-	409,881,724.55
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	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	443,828,243.98	-	-	44,983,203.92	488,811,447.90
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	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	622,450.23	622,450.23
应付托管费	-	-	-	103,741.71	103,741.71
应付销售服务费	-	-	-	37,588.80	37,588.80
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	-	-	-	175.00	175.00
负债总计	-	-	-	763,955.74	763,955.74
利率敏感度缺口	443,828,243.98	-	-	44,219,248.18	488,047,492.16

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（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	-5,969.15	-29,282.23
	2.市场利率平行下降25个基点	6,005.14	29,397.60

6.4.13.4.2 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，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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日					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						
交易性金融资产	-	10,134,229.91	-	-	-	10,134,229.91

资产合计	-	10,134,229.91	-	-	-	10,134,229.91
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	10,134,229.91	-	-	-	10,134,229.91

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						
交易性金融资产	-	4,119,649.60	-	-	-	4,119,649.60
资产合计	-	4,119,649.60	-	-	-	4,119,649.60
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	4,119,649.60	-	-	-	4,119,649.60

6.4.13.4.2.2 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（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%	506,711.50	205,982.48
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-506,711.50	-205,982.48	

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结

合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：本基金股票(含存托凭证)、可转换债券和可交换债券投资合计占基金资产的比例范围为 30%-80%(其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%)。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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。

6.4.13.4.3.1 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	137,050,909.55	70.03	44,983,203.92	9.22
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	137,050,909.55	70.03	44,983,203.92	9.22

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 上升 5%	5,677,836.51	2,427,008.78
	2. 沪深 300 下降 5%	-5,677,836.51	-2,427,008.78

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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	136,705,952.77
第二层次	20,489,895.44
第三层次	375,160.43
合计	157,571,008.64

6.4.14.2.2 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;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,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末:同)。

6.4.14.4 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	137,050,909.55	66.35

	其中：股票	137,050,909.55	66.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,520,099.09	9.93
	其中：债券	20,520,099.09	9.93
	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	17,000,017.00	8.23
	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	31,782,012.58	15.39
8	其他资产	205,564.43	0.10
9	合计	206,558,602.65	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 2,663,200.09 元，占基金资产净值比例 1.36%；通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 7,471,029.82 元，占基金资产净值比例 3.82%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,313,102.52	2.71
C	制造业	80,300,154.01	41.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,676,561.47	1.37
E	建筑业	2,740,553.22	1.40
F	批发和零售业	3,687,745.78	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	4,156,131.00	2.12
H	住宿和餐饮业	369,525.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,007,732.19	8.69
J	金融业	3,370,436.00	1.72
K	房地产业	1,485,435.00	0.76
L	租赁和商务服务业	1,644,362.70	0.84
M	科学研究和技术服务业	255,034.36	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	963,892.45	0.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	196,176.00	0.10
Q	卫生和社会工作	14,783.94	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,688,232.00	0.86
S	综合	1,046,822.00	0.53

合计	126,916,679.64	64.85
----	----------------	-------

7.2.2 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	1,213,823.55	0.62
材料	754,659.07	0.39
工业	904,683.66	0.46
非必需消费	380,316.75	0.19
必需消费品	-	-
医疗保健	625,425.13	0.32
金融	784,466.68	0.40
科技	2,886,498.11	1.47
通讯	2,146,232.06	1.10
公用事业	438,124.90	0.22
房地产	-	-
政府	-	-
合计	10,134,229.91	5.18

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600028	中国石化	441,700	2,809,212.00	1.44
2	00386	中国石油化工股份	190,000	804,058.76	0.41
3	000333	美的集团	53,600	3,158,112.00	1.61
4	000651	格力电器	77,100	2,814,921.00	1.44
5	601966	玲珑轮胎	98,900	2,197,558.00	1.12
6	00981	中芯国际	60,500	1,137,907.72	0.58
7	688981	中芯国际	18,716	945,532.32	0.48
8	601857	中国石油	208,500	1,557,495.00	0.80
9	00857	中国石油股份	82,000	409,764.79	0.21
10	00763	中兴通讯	60,400	1,748,590.39	0.89
11	600012	皖通高速	166,800	1,748,064.00	0.89
12	01055	中国南方航空股份	222,000	904,683.66	0.46
13	600029	南方航空	132,800	800,784.00	0.41
14	600872	中炬高新	46,200	1,699,698.00	0.87
15	001914	招商积余	98,700	1,485,435.00	0.76
16	00700	腾讯控股	4,500	1,375,778.56	0.70

17	600970	中材国际	102,600	1,308,150.00	0.67
18	688036	传音控股	8,791	1,292,277.00	0.66
19	600031	三一重工	77,500	1,288,825.00	0.66
20	601702	华峰铝业	94,000	1,285,920.00	0.66
21	605377	华旺科技	64,800	1,169,640.00	0.60
22	601882	海天精工	32,800	1,092,240.00	0.56
23	688021	奥福环保	39,499	1,023,814.08	0.52
24	002555	三七互娱	29,100	1,015,008.00	0.52
25	002568	百润股份	27,900	1,014,165.00	0.52
26	600859	王府井	49,700	983,563.00	0.50
27	605090	九丰能源	44,000	982,520.00	0.50
28	600566	济川药业	33,400	969,936.00	0.50
29	000848	承德露露	109,500	969,075.00	0.50
30	601717	郑煤机	74,900	932,505.00	0.48
31	603195	公牛集团	9,472	909,880.32	0.46
32	603986	兆易创新	8,500	903,125.00	0.46
33	688008	澜起科技	15,668	899,656.56	0.46
34	600685	中船防务	29,400	880,530.00	0.45
35	002318	久立特材	51,600	878,748.00	0.45
36	000338	潍柴动力	69,900	870,954.00	0.45
37	601985	中国核电	123,000	867,150.00	0.44
38	600079	人福医药	30,700	827,058.00	0.42
39	600963	岳阳林纸	112,000	825,440.00	0.42
40	002517	恺英网络	52,100	820,054.00	0.42
41	000776	广发证券	55,600	817,876.00	0.42
42	688188	柏楚电子	4,304	811,562.24	0.41
43	600603	广汇物流	115,500	803,880.00	0.41
44	688333	铂力特	7,465	789,349.10	0.40
45	00267	中信股份	91,000	784,466.68	0.40
46	600993	马应龙	27,700	770,337.00	0.39
47	603738	泰晶科技	44,450	738,314.50	0.38
48	601618	中国中冶	184,600	732,862.00	0.37
49	603067	振华股份	59,800	726,570.00	0.37
50	688012	中微公司	4,525	707,936.25	0.36
51	600285	羚锐制药	44,000	706,640.00	0.36
52	300138	晨光生物	37,900	678,410.00	0.35
53	300792	壹网壹创	24,300	669,951.00	0.34
54	600584	长电科技	21,300	663,921.00	0.34
55	000938	紫光股份	20,800	662,480.00	0.34
56	002602	世纪华通	86,800	658,812.00	0.34
57	603171	税友股份	16,300	651,674.00	0.33
58	600845	宝信软件	12,700	645,287.00	0.33
59	002773	康弘药业	33,600	642,432.00	0.33

60	002929	润建股份	14,700	638,127.00	0.33
61	688080	映翰通	12,959	633,695.10	0.32
62	600085	同仁堂	10,900	627,404.00	0.32
63	601601	中国太保	24,100	626,118.00	0.32
64	688677	海泰新光	11,003	624,310.22	0.32
65	300132	青松股份	109,300	619,731.00	0.32
66	300348	长亮科技	59,000	615,960.00	0.31
67	688125	安达智能	11,243	611,057.05	0.31
68	601728	中国电信	107,600	605,788.00	0.31
69	002946	新乳业	42,200	605,570.00	0.31
70	002603	以岭药业	23,300	598,577.00	0.31
71	688078	龙软科技	11,537	594,732.35	0.30
72	002444	巨星科技	27,100	592,948.00	0.30
73	002401	中远海科	22,300	586,936.00	0.30
74	300845	捷安高科	26,900	584,537.00	0.30
75	688618	三旺通信	8,602	582,527.44	0.30
76	002368	太极股份	14,000	576,380.00	0.29
77	600332	白云山	18,000	573,840.00	0.29
78	601607	上海医药	25,600	573,696.00	0.29
79	688200	华峰测控	3,728	570,384.00	0.29
80	601800	中国交建	52,100	568,411.00	0.29
81	000997	新大陆	29,400	555,660.00	0.28
82	300628	亿联网络	15,700	550,599.00	0.28
83	688037	芯源微	3,209	548,578.55	0.28
84	601058	赛轮轮胎	47,600	542,164.00	0.28
85	000513	丽珠集团	13,900	540,849.00	0.28
86	002153	石基信息	38,480	538,720.00	0.28
87	601138	工业富联	21,100	531,720.00	0.27
88	300627	华测导航	16,100	522,767.00	0.27
89	002092	中泰化学	79,800	514,710.00	0.26
90	600398	海澜之家	74,200	510,496.00	0.26
91	003011	海象新材	15,800	509,550.00	0.26
92	688191	智洋创新	27,394	505,967.18	0.26
93	000951	中国重汽	30,000	505,500.00	0.26
94	300308	中际旭创	3,400	501,330.00	0.26
95	002327	富安娜	59,500	500,990.00	0.26
96	000975	银泰黄金	42,800	500,760.00	0.26
97	603501	韦尔股份	5,100	500,004.00	0.26
98	300860	锋尚文化	9,000	498,960.00	0.25
99	603324	盛剑环境	13,100	493,870.00	0.25
100	002262	恩华药业	16,000	493,280.00	0.25
101	003031	中瓷电子	3,700	492,544.00	0.25
102	300026	红日药业	90,600	491,052.00	0.25

103	605168	三人行	5,655	485,990.70	0.25
104	300470	中密控股	10,500	485,310.00	0.25
105	603283	赛腾股份	10,900	485,050.00	0.25
106	603690	至纯科技	13,920	484,972.80	0.25
107	603379	三美股份	20,500	481,955.00	0.25
108	002655	共达电声	36,500	474,135.00	0.24
109	688786	悦安新材	10,096	468,353.44	0.24
110	600004	白云机场	32,600	467,484.00	0.24
111	603915	国茂股份	21,800	461,724.00	0.24
112	300130	新国都	16,200	458,946.00	0.23
113	002236	大华股份	23,200	458,200.00	0.23
114	002027	分众传媒	67,200	457,632.00	0.23
115	002595	豪迈科技	12,800	449,664.00	0.23
116	688111	金山办公	938	442,942.36	0.23
117	600771	广誉远	12,500	440,875.00	0.23
118	02380	中国电力	165,000	438,124.90	0.22
119	000059	华锦股份	68,900	433,381.00	0.22
120	601528	瑞丰银行	88,920	431,262.00	0.22
121	600977	中国电影	30,500	428,525.00	0.22
122	002698	博实股份	24,400	426,756.00	0.22
123	01378	中国宏桥	72,500	425,124.98	0.22
124	000403	派林生物	21,200	423,152.00	0.22
125	688772	珠海冠宇	20,971	422,565.65	0.22
126	00762	中国联通	88,000	420,275.36	0.21
127	000708	中信特钢	26,500	419,760.00	0.21
128	688639	华恒生物	4,591	415,393.68	0.21
129	000922	佳电股份	31,300	411,908.00	0.21
130	600153	建发股份	37,600	410,216.00	0.21
131	601825	沪农商行	75,200	409,840.00	0.21
132	002126	银轮股份	23,100	408,870.00	0.21
133	603039	泛微网络	5,000	408,150.00	0.21
134	603087	甘李药业	10,600	408,100.00	0.21
135	002841	视源股份	6,100	407,724.00	0.21
136	300408	三环集团	13,800	405,030.00	0.21
137	300969	恒帅股份	4,500	396,675.00	0.20
138	601339	百隆东方	70,800	396,480.00	0.20
139	600105	永鼎股份	53,200	396,340.00	0.20
140	600803	新奥股份	20,800	394,784.00	0.20
141	002803	吉宏股份	19,000	388,740.00	0.20
142	603129	春风动力	2,400	388,560.00	0.20
143	300556	丝路视觉	15,800	387,732.00	0.20
144	300252	金信诺	34,400	386,656.00	0.20
145	600056	中国医药	29,700	385,506.00	0.20

146	688016	心脉医疗	2,089	375,769.32	0.19
147	301391	卡莱特	3,200	374,944.00	0.19
148	603878	武进不锈	44,100	372,645.00	0.19
149	002532	天山铝业	62,000	371,380.00	0.19
150	300058	蓝色光标	38,300	370,361.00	0.19
151	600258	首旅酒店	19,500	369,525.00	0.19
152	002864	盘龙药业	8,600	362,662.00	0.19
153	002738	中矿资源	7,100	361,674.00	0.18
154	300351	永贵电器	22,000	361,460.00	0.18
155	301419	阿莱德	7,800	359,034.00	0.18
156	688156	路德环境	12,475	357,658.25	0.18
157	00425	敏实集团	18,000	356,806.26	0.18
158	600941	中国移动	2,200	205,260.00	0.10
159	00941	中国移动	2,500	147,632.05	0.08
160	300253	卫宁健康	32,200	348,404.00	0.18
161	300003	乐普医疗	15,300	345,933.00	0.18
162	600183	生益科技	24,300	345,060.00	0.18
163	300481	濮阳惠成	16,500	339,240.00	0.17
164	688696	极米科技	2,397	334,117.83	0.17
165	688466	金科环境	16,595	331,236.20	0.17
166	600790	轻纺城	76,300	330,379.00	0.17
167	02689	玖龙纸业	74,000	329,534.09	0.17
168	600511	国药股份	8,400	326,340.00	0.17
169	300873	海晨股份	16,300	324,207.00	0.17
170	600125	铁龙物流	53,500	323,140.00	0.17
171	603345	安井食品	2,200	322,960.00	0.17
172	000811	冰轮环境	20,400	321,504.00	0.16
173	688211	中科微至	6,974	315,015.58	0.16
174	01801	信达生物	11,500	313,841.99	0.16
175	02269	药明生物	9,000	311,583.14	0.16
176	688232	新点软件	5,788	311,452.28	0.16
177	688368	晶丰明源	2,445	311,028.45	0.16
178	688668	鼎通科技	3,178	310,808.40	0.16
179	688569	铁科轨道	6,977	293,522.39	0.15
180	000050	深天马 A	31,800	291,924.00	0.15
181	688378	奥来德	5,865	289,731.00	0.15
182	688003	天准科技	6,445	287,640.35	0.15
183	300592	华凯易佰	10,400	283,088.00	0.14
184	601098	中南传媒	24,400	283,040.00	0.14
185	688120	华海清科	1,101	277,507.05	0.14
186	600528	中铁工业	28,000	276,640.00	0.14
187	000883	湖北能源	60,200	274,512.00	0.14
188	601000	唐山港	77,200	272,516.00	0.14

189	600323	瀚蓝环境	14,200	268,806.00	0.14
190	600985	淮北矿业	23,201	267,275.52	0.14
191	002080	中材科技	12,800	262,656.00	0.13
192	600976	健民集团	3,400	262,106.00	0.13
193	002381	双箭股份	33,100	255,532.00	0.13
194	600572	康恩贝	37,300	255,505.00	0.13
195	600267	海正药业	22,200	252,636.00	0.13
196	603909	建发合诚	18,590	247,804.70	0.13
197	603228	景旺电子	9,637	247,189.05	0.13
198	600212	绿能慧充	25,900	242,942.00	0.12
199	300168	万达信息	21,400	242,462.00	0.12
200	601398	工商银行	50,200	241,964.00	0.12
201	300251	光线传媒	29,800	241,082.00	0.12
202	600050	中国联通	49,800	239,040.00	0.12
203	688777	中控技术	3,787	237,747.86	0.12
204	300182	捷成股份	37,500	236,625.00	0.12
205	002463	沪电股份	11,300	236,622.00	0.12
206	300573	兴齐眼药	1,100	235,180.00	0.12
207	688687	凯因科技	7,950	234,525.00	0.12
208	600998	九州通	22,499	233,539.62	0.12
209	600176	中国巨石	16,400	232,224.00	0.12
210	002131	利欧股份	100,500	231,150.00	0.12
211	301006	迈拓股份	8,800	230,120.00	0.12
212	000860	顺鑫农业	6,800	229,092.00	0.12
213	002916	深南电路	3,000	226,110.00	0.12
214	002948	青岛银行	72,200	225,986.00	0.12
215	688139	海尔生物	4,389	225,901.83	0.12
216	688372	伟测科技	1,471	225,283.65	0.12
217	300232	洲明科技	24,400	223,016.00	0.11
218	301269	华大九天	1,800	221,112.00	0.11
219	688425	铁建重工	45,835	220,466.35	0.11
220	600026	中远海能	17,400	219,936.00	0.11
221	002185	华天科技	23,900	219,880.00	0.11
222	000676	智度股份	31,300	219,413.00	0.11
223	000950	重药控股	32,300	217,379.00	0.11
224	603960	克来机电	11,600	216,340.00	0.11
225	601555	东吴证券	30,700	213,058.00	0.11
226	002612	朗姿股份	8,900	211,642.00	0.11
227	600958	东方证券	21,700	210,490.00	0.11
228	600460	士兰微	6,900	208,863.00	0.11
229	300054	鼎龙股份	8,300	205,259.00	0.10
230	688279	峰岬科技	1,526	201,432.00	0.10
231	300534	陇神戎发	19,500	197,340.00	0.10

232	600600	青岛啤酒	1,900	196,897.00	0.10
233	603377	东方时尚	24,400	196,176.00	0.10
234	002987	京北方	8,900	195,088.00	0.10
235	688266	泽璟制药	4,177	194,439.35	0.10
236	603093	南华期货	17,800	193,842.00	0.10
237	688426	康为世纪	6,385	192,827.00	0.10
238	001270	铖昌科技	2,200	192,060.00	0.10
239	603596	伯特利	2,400	190,224.00	0.10
240	300682	朗新科技	8,100	188,568.00	0.10
241	603019	中科曙光	3,700	188,330.00	0.10
242	688121	卓然股份	4,951	185,167.40	0.09
243	301308	江波龙	1,800	183,168.00	0.09
244	002292	奥飞娱乐	18,300	182,634.00	0.09
245	603279	景津装备	5,800	181,888.00	0.09
246	300613	富瀚微	3,200	181,568.00	0.09
247	600256	广汇能源	26,000	178,360.00	0.09
248	603236	移远通信	3,080	177,746.80	0.09
249	01024	快手-W	3,600	177,739.30	0.09
250	002068	黑猫股份	14,800	175,676.00	0.09
251	301063	海锅股份	6,300	175,518.00	0.09
252	603208	江山欧派	4,680	170,445.60	0.09
253	688283	坤恒顺维	2,523	167,829.96	0.09
254	600984	建设机械	36,700	165,884.00	0.08
255	300031	宝通科技	6,700	165,624.00	0.08
256	301299	卓创资讯	2,900	165,474.00	0.08
257	300571	平治信息	4,100	143,336.00	0.07
258	600419	天润乳业	8,700	141,114.00	0.07
259	301325	曼恩斯特	1,136	129,325.30	0.07
260	601390	中国中铁	16,900	128,102.00	0.07
261	688443	智翔金泰	4,072	125,286.16	0.06
262	000690	宝新能源	17,400	122,148.00	0.06
263	002222	福晶科技	4,100	113,734.00	0.06
264	601877	正泰电器	4,100	113,365.00	0.06
265	002242	九阳股份	7,400	110,630.00	0.06
266	000661	长春高新	800	109,040.00	0.06
267	002558	巨人网络	6,000	107,580.00	0.05
268	301367	怡和嘉业	700	103,838.00	0.05
269	688099	晶晨股份	1,203	101,436.96	0.05
270	688630	芯碁微装	1,170	98,303.40	0.05
271	688475	萤石网络	2,182	93,520.52	0.05
272	300634	彩讯股份	3,300	87,120.00	0.04
273	688112	鼎阳科技	1,649	87,034.22	0.04
274	688006	杭可科技	2,488	75,809.36	0.04

275	688361	中科飞测	903	70,813.19	0.04
276	600037	歌华有线	7,700	63,987.00	0.03
277	688478	晶升股份	1,284	59,681.86	0.03
278	688603	天承科技	1,043	57,365.00	0.03
279	688631	莱斯信息	1,730	55,863.43	0.03
280	688623	双元科技	592	54,082.24	0.03
281	002311	海大集团	1,100	51,524.00	0.03
282	688582	芯动联科	1,107	50,493.21	0.03
283	000733	振华科技	500	47,925.00	0.02
284	603811	诚意药业	3,780	46,985.40	0.02
285	688479	友车科技	1,493	46,687.71	0.02
286	600380	健康元	2,900	36,859.00	0.02
287	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
288	600059	古越龙山	2,900	30,102.00	0.02
289	03690	美团-W	220	24,806.79	0.01
290	01797	东方甄选	1,000	23,510.49	0.01
291	688249	晶合集成	1,247	22,520.82	0.01
292	688472	阿特斯	919	15,659.76	0.01
293	301293	三博脑科	207	14,783.94	0.01
294	688469	中芯集成	2,471	13,368.11	0.01
295	002938	鹏鼎控股	500	12,145.00	0.01
296	688562	航天软件	494	11,021.14	0.01
297	688629	华丰科技	590	10,968.10	0.01
298	688531	日联科技	75	10,197.75	0.01
299	688576	西山科技	80	9,632.80	0.00
300	301382	蜂助手	288	9,457.92	0.00
301	688146	中船特气	219	8,350.47	0.00
302	688458	美芯晟	91	8,259.16	0.00
303	688352	颀中科技	661	7,978.27	0.00
304	688620	安凯微	645	7,959.30	0.00
305	688535	华海诚科	142	7,274.66	0.00
306	688334	西高院	446	7,229.66	0.00
307	688512	慧智微	372	7,127.52	0.00
308	688543	国科军工	134	7,108.70	0.00
309	688570	天玛智控	277	7,016.41	0.00
310	001287	中电港	316	6,642.32	0.00
311	301357	北方长龙	137	6,629.43	0.00
312	688433	华曙高科	209	6,583.50	0.00
313	301439	泓淋电力	380	6,422.00	0.00
314	688429	时创能源	251	6,408.03	0.00
315	301203	国泰环保	180	6,192.00	0.00
316	301428	世纪恒通	201	6,150.60	0.00
317	301337	亚华电子	192	5,831.04	0.00

318	601061	中信金属	748	5,669.84	0.00
319	688418	震有科技	250	5,270.00	0.00
320	301345	涛涛车业	106	4,943.84	0.00
321	601133	柏诚股份	247	3,028.22	0.00
322	601065	江盐集团	254	3,007.36	0.00
323	001328	登康口腔	103	2,625.47	0.00
324	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
325	603125	常青科技	81	1,986.93	0.00
326	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
327	001360	南矿集团	131	1,947.97	0.00
328	001367	海森药业	47	1,855.56	0.00
329	688246	嘉和美康	41	1,716.67	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	2,689,707.00	0.55
2	600012	皖通高速	2,601,850.00	0.53
3	600827	百联股份	2,451,005.00	0.50
4	000333	美的集团	2,395,548.00	0.49
5	600955	维远股份	1,977,337.00	0.41
6	600031	三一重工	1,970,084.00	0.40
7	300253	卫宁健康	1,967,414.54	0.40
8	300870	欧陆通	1,961,067.00	0.40
9	600801	华新水泥	1,881,872.00	0.39
10	002946	新乳业	1,852,125.00	0.38
11	002568	百润股份	1,808,156.00	0.37
12	600872	中炬高新	1,769,928.00	0.36
13	688156	路德环境	1,731,945.11	0.35
14	300623	捷捷微电	1,713,138.00	0.35
15	601236	红塔证券	1,567,067.00	0.32
16	601857	中国石油	1,547,530.00	0.32
17	605377	华旺科技	1,504,273.00	0.31
18	603379	三美股份	1,475,811.00	0.30
19	300003	乐普医疗	1,475,667.06	0.30
20	601702	华峰铝业	1,473,981.00	0.30

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300870	欧陆通	3,640,447.00	0.75
2	600827	百联股份	3,015,252.00	0.62
3	600958	东方证券	2,024,687.00	0.41
4	600955	维远股份	1,967,228.00	0.40
5	002372	伟星新材	1,860,056.00	0.38
6	300253	卫宁健康	1,808,544.00	0.37
7	600801	华新水泥	1,795,458.00	0.37
8	002946	新乳业	1,646,294.00	0.34
9	601236	红塔证券	1,604,172.00	0.33
10	000001	平安银行	1,536,407.00	0.31
11	300623	捷捷微电	1,517,670.00	0.31
12	000988	华工科技	1,354,693.00	0.28
13	603327	福蓉科技	1,298,584.40	0.27
14	600970	中材国际	1,297,792.00	0.27
15	688156	路德环境	1,277,153.06	0.26
16	002558	巨人网络	1,262,959.00	0.26
17	002236	大华股份	1,255,808.00	0.26
18	603915	国茂股份	1,216,315.00	0.25
19	600012	皖通高速	1,214,792.00	0.25
20	300653	正海生物	1,145,726.00	0.23

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	234,279,010.03
卖出股票收入（成交）总额	149,186,480.72

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	10,132,009.89	5.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,300,520.55	5.26
	其中：政策性金融债	10,300,520.55	5.26

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）	87,568.65	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,520,099.09	10.48

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	200313	20 进出 13	100,000	10,300,520.55	5.26
2	019638	20 国债 09	99,000	10,132,009.89	5.18
3	113669	景 23 转债	630	87,568.65	0.04

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本，以达到降低投资组合整体风险的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	105,440.51
4	应收利息	-
5	应收申购款	100,123.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	205,564.43

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
南方君誉混合 A	3,802	44,937.93	584,981.58	0.34%	170,269,038.70	99.66%
南方君誉混合 C	562	42,593.50	4,000.18	0.02%	23,933,547.55	99.98%
合计	4,364	44,636.01	588,981.76	0.30%	194,202,586.25	99.70%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	南方君誉混合 A	10,111.78	0.0059%
	南方君誉混合 C	14.00	0.0001%
	合计	10,125.78	0.0052%

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	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	南方君誉混合 A	0
	南方君誉混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方君誉混合 A	0~10
	南方君誉混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方君誉混合 A	南方君誉混合 C
基金合同生效日(2022 年 11 月 15 日)基金份额总额	415,826,354.57	73,977,125.16
本报告期期初基金份额总额	415,826,354.57	73,977,125.16
本报告期基金总申购份额	62,264,288.23	15,386,206.81
减: 报告期基金总赎回份额	307,236,622.52	65,425,784.24
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	170,854,020.28	23,937,547.73

§ 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

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	
长江证券	2	379,765,744.28	100.00%	285,437.59	100.00%	-

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：

无

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	
	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
长江证券	-	-	8,379,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方君誉混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	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	2023-02-08
2	南方基金关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-03-03
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	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	2023-03-22
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	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	2023-03-23
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	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	2023-04-15
6	南方基金关于旗下部分基金增加诺亚正行为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-04-17
7	南方基金关于旗下部分基金增加兴业证券为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-04-27
8	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	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	2023-04-29
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	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	2023-05-10
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	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	2023-06-03
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	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	2023-06-21

§ 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君誉混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方君誉混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方君誉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、《南方君誉混合型证券投资基金 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>