

# 南方全球精选配置证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	5
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	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	12
§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	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	42
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	45

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	48
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.....	48
§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.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
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.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方全球精选配置证券投资基金
基金简称	南方全球精选配置股票（QDII-FOF）
基金主代码	202801
交易代码	202801
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 9 月 19 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,848,361,138.54 份
基金合同存续期	不定期

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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过基金全球化的资产配置和组合管理，实现组合资产的分散化投资，在降低组合波动性的同时，实现基金资产的最大增值。
投资策略	本基金在基金资产的配置上采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的配置策略，在有效分散风险的基础上，提高基金资产的收益。1、战略性资产配置策略（Strategic Asset Allocation）在宏观经济与地区经济分析、掌握全球经济趋势的基础上，通过量化分析，确定资产种类(Asset Class)与权重，并定期进行回顾和动态调整。2、战术性资产配置策略（Tactical Asset Allocation）在成熟市场和新兴市场中根据不同国家和地区经济发展及证券市场的发展变化对资产进行国家及区域配置，在不同国家的配置比例上采用“全球资产配置量化”模型进行配置和调整。由于短期市场会受到一些非理性或者非基本面因素的影响而产生波动，基金经理将根据对不同因素的研究与判断，对基金投资组合进行调整，以降低投资组合的投资风险。本基金的大部分资产将投资于 ETF 基金、股票型基金和在香港市场投资于公开发行的、上市的股票。利用定量和定性的方式筛选基金，在香港市场的选股策略的主要标准：市场及行业地位（market position）、估值（intrinsic value）、盈利预期（earning surprise）、和良好的趋势（investment trend）。
业绩比较基准	60%×MSCI 世界指数（MSCI World Index）+40%×MSCI 新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index）。
风险收益特征	本基金为基金中基金，属于中等偏高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和收益水平低于全球股票型基金、高于债券基金及货币市场基金。前款有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同销售机构采用的

	评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同。本基金的风险等级可能有相应变化，具体风险评级结果应以销售机构的评级结果为准。
--	---

### 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	中国工商银行股份有限公司
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	95588
传真	0755-82763889	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码	518017	100140
法定代表人	周易	陈四清

### 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	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-55,670,158.68
本期利润	23,457,913.00
加权平均基金份额本期利润	0.0124
本期加权平均净值利润率	1.41%
本期基金份额净值增长率	1.48%
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	-198,251,578.90
期末可供分配基金份额利润	-0.1073
期末基金资产净值	1,650,109,559.64
期末基金份额净值	0.893
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	1.10%

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	5.81%	0.99%	6.98%	0.66%	-1.17%	0.33%
过去三个月	0.90%	0.86%	9.06%	0.65%	-8.16%	0.21%
过去六个月	1.48%	0.93%	7.61%	0.54%	-6.13%	0.39%
过去一年	0.68%	1.05%	11.67%	0.45%	-10.99%	0.60%
过去三年	-9.91%	1.08%	46.48%	0.59%	-56.39%	0.49%



自基金合同生效起至今	1.10%	1.11%	101.91%	1.09%	-100.81%	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

南方全球精选配置股票（QDII-FOF）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		
黄亮	本基金基金经理	2009年6月25日	-	22年	北京大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾任职于招商证券股份有限公司、天华投资有限责任公司，2005年加入南方基金国际业务部，现任国际业务部总经理、国际投资决策委员会委员；2011年9月26日至2015年5月13日，任南方中国中小盘基金经理；2015年5月13日至2017年11月9日，任南方香港优选基金经理；2017年4月26日至2019年4月22日，任国企精明基金经理；2010年12月9日至2020年9月18日，任南方金砖基金经理；2019年4月3日至2021年9月29日，任南方香港成长基金经理；2016年6月15日至2021年11月19日，任南方原油基金经理；2017年10月26日至2021年11月19日，任美国REIT基金经理；2009年6月25日至今，任南方全球基金经理；2020年12月25日至今，任南方沪港深优势基金经理；2021年4月2日至今，兼任投资经理；2021年8月10日至今，任南方中国新兴经济9个月持有期混合（QDII）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。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
黄亮	公募基金	3	2,100,132,366.07	2009年06月25日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	1	0.00	2021年02月05日
	合计	4	2,100,132,366.07	-

## 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

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

#### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

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

在大类资产配置方面，报告期内本基金保持了相对均衡的资产配置。在区域配置上报告期内增加了对于中国资产的配置，继续超配美国和中国，低配欧洲和其他新兴市场。对于中资的超配在报告期内影响了基金的表现。港股投资上，在保持港股行业长期相对均衡的配置的基础上，二季度在维持了原有对于互联网、可选消费等新经济领域的超配之外，增加了具有一定成长性，低估值的传统行业个股的配置。

#### 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0.893元，报告期内，份额净值增长率为1.48%，同期业绩基准增长率为7.61%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为依然需要关注以下主要影响因素：1) 美联储的货币政策节奏。我们认为随着美国通胀压力的缓解以及对于经济下行的担忧，美联储本轮加息已经进入到尾声。未来对于降息预期的提升以及降息周期的开始都将有利于全球风险资产的定价，对新兴经济体相对更加友好。因此，2023 年下半年我们更加看好新兴市场和成长风格的投资机会。2) 通胀。本轮通胀并非经济活动过热造成，受到疫情和地缘政治影响的供给端是通胀最主要的源头。这两个因素今年的影响都将逐步消退，同时叠加基数效应，通胀压力在今年中期已经得到大幅缓解。当前需要警惕的是下半年随着基数效应的消退，美国通胀数字有较大概率会出现一定幅度的上行，对于美国的货币宽松政策造成一定的限制，从而导致美国高利率会维持较长的一段时间。3) 中国经济是否能够在下半年出现较好的修复增长势头。我们认为稳经济的大方向不会发生变化，刺激政策的传导过程和效果也会有所改善，复苏虽然比市场预期的慢，但大概率不会缺席。

对于上半年表现较好的发达市场，我们认为下半年要保持一定的谨慎。一方面高利率对于企业盈利的影响将在今年中报中逐步显现出来。另一方面，目前相对较高的利率环境持续时间有可能会超出市场预期，也将会对风险资产的估值造成不利的的影响。虽然在 2022 年底港股多数板块和个股的估值都得到了一定的修复，但我们仍然认为当前港股市场是全球主要市场中具备估值优势和成长潜力的双重优势市场。海外资金对于港股从低配的转向也会为整个市场带来增量的资金支持。在行业和个股上，受益于政策面调整的新经济领域以及受益于稳经济政策的传统经济领域都有较好的投资机会。

#### 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

本报告期内,本基金托管人在对本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,南方全球的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方全球的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,南方全球未进行利润分配。

#### 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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方全球精选配置(QDII-FOF)2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体:南方全球精选配置证券投资基金

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	98,542,999.58	145,177,894.62
结算备付金		-	-
存出保证金		13,614,974.46	10,002,009.86
交易性金融资产	6.4.7.2	1,538,957,674.54	1,550,695,890.74
其中：股票投资		478,369,420.72	555,614,380.37
基金投资		1,060,588,253.82	995,081,510.37
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	6.4.7.3	79,866.52	83,007.11
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		4,539,342.30	351,663.48
应收申购款		68,597.24	459,306.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,655,803,454.64	1,706,769,772.79
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		6.07	6.67
应付赎回款		2,631,763.82	1,436,565.80
应付管理人报酬		2,505,861.46	2,691,265.96
应付托管费		406,355.89	436,421.53
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	6.4.7.9	149,907.76	142,648.71
负债合计		5,693,895.00	4,706,908.67
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,848,361,138.54	1,933,072,358.03
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-198,251,578.90	-231,009,493.91
净资产合计		1,650,109,559.64	1,702,062,864.12
负债和净资产总计		1,655,803,454.64	1,706,769,772.79

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.893 元，基金份额总额 1,848,361,138.54 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方全球精选配置证券投资基金

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		41,412,778.07	-285,752,388.17
1.利息收入		211,716.62	115,835.92
其中：存款利息收入	6.4.7.13	211,716.62	115,835.92
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		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-43,283,371.08	-54,730,627.46
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-44,031,320.42	-147,868,218.35
基金投资收益	6.4.7.15	-10,446,754.61	79,300,804.28
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-1.01
股利收益	6.4.7.20	11,194,703.95	13,836,787.62
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）	6.4.7.21	79,128,071.68	-238,238,662.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		5,320,374.24	7,094,470.25
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	35,986.61	6,596.02
减：二、营业总支出		17,954,865.07	19,415,931.49
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	15,306,466.40	16,577,933.05
2.托管费	6.4.10.2.2	2,482,129.70	2,688,313.52
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.23	-	-
7.税金及附加		14,918.83	11,101.80
8.其他费用	6.4.7.24	151,350.14	138,583.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,457,913.00	-305,168,319.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,457,913.00	-305,168,319.66
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		23,457,913.00	-305,168,319.66

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方全球精选配置证券投资基金

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）	1,933,072,358.03	-	-231,009,493.91	1,702,062,864.12
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)	1,933,072,358.03	-	-231,009,493.91	1,702,062,864.12
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-84,711,219.49	-	32,757,915.01	-51,953,304.48
(一)、综合收益总额	-	-	23,457,913.00	23,457,913.00
(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)	-84,711,219.49	-	9,300,002.01	-75,411,217.48
其中: 1.基金申购款	2,942,176.53	-	-325,163.20	2,617,013.33
2.基金赎回款	-87,653,396.02	-	9,625,165.21	-78,028,230.81
(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)	1,848,361,138.54	-	-198,251,578.90	1,650,109,559.64
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)	1,944,276,605.86	-	210,965,473.80	2,155,242,079.66
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)	1,944,276,605.86	-	210,965,473.80	2,155,242,079.66
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,685,888.73	-	-430,306,265.77	-433,992,154.50
(一)、综合收益总额	-	-	-305,168,319.66	-305,168,319.66
(二)、本期基金	-3,685,888.73	-	2,649,782.81	-1,036,105.92

份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	50,027,169.65	-	-432,617.17	49,594,552.48
2.基金赎回款	-53,713,058.38	-	3,082,399.98	-50,630,658.40
（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）	-	-	-127,787,728.92	-127,787,728.92
（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）	1,940,590,717.13	-	-219,340,791.97	1,721,249,925.16

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

### 6.4.2 会计报表的编制基础

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

### 6.4.4 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。

#### 6.4.4.1 会计年度

#### 6.4.4.2 记账本位币

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

**6.4.4.7 实收基金****6.4.4.8 损益平准金****6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量****6.4.4.10 费用的确认和计量****6.4.4.11 基金的收益分配政策****6.4.4.12 外币交易****6.4.4.13 分部报告****6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计****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**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

**6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

**6.4.5.3 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。

**6.4.6 税项****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	98,542,999.58
等于：本金	98,540,396.46
加：应计利息	2,603.12
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	98,542,999.58

#### 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	567,847,605.21	-	478,369,420.72	-89,478,184.49
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	899,319,822.17	-	1,060,588,253.82	161,268,431.65
其他	-	-	-	-
合计	1,467,167,427.38	-	1,538,957,674.54	71,790,247.16

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	0.00	79,866.52	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	0.00	79,866.52	-	-

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末及上年度末无期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 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

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

**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。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明****6.4.7.5 债权投资****6.4.7.5.1 债权投资情况****6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况****6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况****6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况****6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况****6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况****6.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.9 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	357.19
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	36,450.57
其中：交易所市场	36,450.57
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	113,100.00
其他	-
合计	149,907.76

**6.4.7.10 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	1,933,072,358.03	1,933,072,358.03
本期申购	2,942,176.53	2,942,176.53
本期赎回（以“-”号填列）	-87,653,396.02	-87,653,396.02
基金拆分/份额折算前	-	-

基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,848,361,138.54	1,848,361,138.54

注：申购含红利再投份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

#### 6.4.7.12 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	261,037,829.58	-492,047,323.49	-231,009,493.91
本期利润	-55,670,158.68	79,128,071.68	23,457,913.00
本期基金份额交易产生的变动数	-11,154,087.24	20,454,089.25	9,300,002.01
其中：基金申购款	384,649.64	-709,812.84	-325,163.20
基金赎回款	-11,538,736.88	21,163,902.09	9,625,165.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	194,213,583.66	-392,465,162.56	-198,251,578.90

#### 6.4.7.13 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	211,704.50
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	12.12
合计	211,716.62

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 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	-44,031,320.42
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	-44,031,320.42

##### 6.4.7.14.2 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	247,360,862.80
减：卖出股票成本总额	289,753,167.81
减：交易费用	1,639,015.41
买卖股票差价收入	-44,031,320.42

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

#### 6.4.7.14.3 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。

#### 6.4.7.14.4 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。

#### 6.4.7.14.5 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。

#### 6.4.7.15 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	390,442,361.07
减：卖出/赎回基金成本总额	400,218,901.06
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	124,323.52
减：交易费用	545,891.10
基金投资收益	-10,446,754.61

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。

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 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。

##### 6.4.7.16.2 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。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

##### 6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

##### 6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

##### 6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

**6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入****6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入****6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入****6.4.7.19 衍生工具收益****6.4.7.19.1 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。

**6.4.7.19.2 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。

**6.4.7.20 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	7,581,948.08
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	3,612,755.87
合计	11,194,703.95

**6.4.7.21 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	79,131,212.27
——股票投资	-22,083,409.63
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	101,214,621.90
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-3,140.59
——权证投资	-3,140.59
——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	79,128,071.68

**6.4.7.22 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	35,986.61



合计	35,986.61
----	-----------

注：本基金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。

#### 6.4.7.23 信用减值损失

#### 6.4.7.24 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	49,092.63
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	468.64
其他	42,281.50
合计	151,350.14

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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。

#### 6.4.10 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

### 6.4.10.1.4 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

### 6.4.10.1.5 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。

### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间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	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理费	15,306,466.40	16,577,933.05
其中：支付销售机构的客户维护费	4,395,327.74	4,598,664.24

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 1.85% 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 × 1.85% / 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	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	2,482,129.70	2,688,313.52

注：支付基金托管人中国工商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。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

## 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。

**6.4.10.4 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。

**6.4.10.4.2 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。

**6.4.10.5 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		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	60,914,342.88	151,322.30	64,127,302.87	4,865.68
中国工商银行	37,628,656.70	60,382.20	67,222,555.78	108,473.64

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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。

**6.4.10.7 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。

**6.4.10.8 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

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。

#### 6.4.12.2 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

本基金投资的金融工具主要包括股票投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等，在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的

限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 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中国工商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)。

#### 6.4.13.3 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。

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 (所有者权益) 无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 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。

#### 6.4.13.3.2 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,本基金无流动性受限资产。

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

#### 6.4.13.4 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和存出保证金等。

#### 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	52,114,331.76	-	-	46,428,667.82	98,542,999.58
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	2,074.46	-	-	13,612,900.00	13,614,974.46
交易性金融资产	-	-	-	1,538,957.674.54	1,538,957.674.54
衍生金融资产	-	-	-	79,866.52	79,866.52
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	-	-	-	4,539,342.30	4,539,342.30
应收申购款	1,552.00	-	-	67,045.24	68,597.24
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	52,117,958.22	-	-	1,603,685.496.42	1,655,803.454.64
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	-	-	-	6.07	6.07
应付赎回款	-	-	-	2,631,763.82	2,631,763.82

应付管理人报酬	-	-	-	2,505,861.46	2,505,861.46
应付托管费	-	-	-	406,355.89	406,355.89
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	-	-	-	149,907.76	149,907.76
负债总计	-	-	-	5,693,895.00	5,693,895.00
利率敏感度缺口	52,117,958.22	-	-	1,597,991.601.42	1,650,109.559.64
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	80,423,779.69	-	-	64,754,114.93	145,177,894.62
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	10,002,009.86	10,002,009.86
交易性金融资产	-	-	-	1,550,695.890.74	1,550,695.890.74
衍生金融资产	83,007.11	-	-	-	83,007.11
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	-	-	-	351,663.48	351,663.48
应收申购款	5,639.17	-	-	453,667.81	459,306.98
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	80,512,425.97	-	-	1,626,257.346.82	1,706,769.772.79



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	-	-	-	6.67	6.67
应付赎回款	-	-	-	1,436,565.80	1,436,565.80
应付管理人 报酬	-	-	-	2,691,265.96	2,691,265.96
应付托管费	-	-	-	436,421.53	436,421.53
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	-	-	-	142,648.71	142,648.71
负债总计	-	-	-	4,706,908.67	4,706,908.67
利率敏感度 缺口	80,512,425.9 7	-	-	1,621,550.43 8.15	1,702,062.86 4.12

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	0.00	0.00
2.市场利率平行下降25个基点	0.00	0.00	

#### 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					
	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	28,962,479.31	45,768,613.03	6,976.43	4.11	-	74,738,072.88
存出保证金	3,612,900.00	2,074.46	-	-	-	3,614,974.46
交易性金融资产	1,060,588,253.82	478,369,420.72	-	-	-	1,538,957,674.54
应收股利	302,587.17	3,734,676.73	-	-	-	4,037,263.90
资产合计	1,093,466,220.30	527,874,784.94	6,976.43	4.11	-	1,621,347,985.78
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	1,093,466,220.30	527,874,784.94	6,976.43	4.11	-	1,621,347,985.78

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	27,908,960.00	64,087,238.17	6,560.66	4.29	-	92,002,763.12
存出保证金	-	2,009.86	-	-	-	2,009.86
交易性金融资产	995,081,510.37	555,614,380.37	-	-	-	1,550,695,890.74
衍生金融工具	-	83,007.11	-	-	-	83,007.11
应收股利	351,663.48	-	-	-	-	351,663.48
资产合计	1,023,342,133.85	619,786,635.51	6,560.66	4.29	-	1,643,135,334.31
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风	1,023,342,133.85	619,786,635.51	6,560.66	4.29	-	1,643,135,334.31

险敞口净额						
-------	--	--	--	--	--	--

#### 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%	81,071,382.57	82,156,766.72
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-81,071,382.57	-82,156,766.72	

#### 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交易的股票和基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的配置策略，在宏观经济与地区经济分析、掌握全球经济趋势的基础上，通过量化分析，确定资产种类与权重，并定期进行回顾和动态调整。本基金将全球股票市场分为成熟市场和新兴市场两类，根据全球经济以及区域化经济发展，结合全球范围的资本流动，确定两类市场具体的资产配置比例并定期进行调整，争取构建具备中长期发展潜力的资产组合。在成熟市场和新兴市场中根据不同国家和地区经济发展及证券市场的发展变化对资产进行国家及区域配置，在不同国家或地区的配置比例上采用“全球资产配置量化”模型进行配置和调整。由于短期市场会受到一些非理性或者非基本面因素的影响而产生波动，基金经理将根据对不同因素的研究与判断，对基金投资组合进行调整，以降低投资组合的投资风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中基金和股票投资比例为基金资产的 60%-100%，货币市场工具及其他金融工具占基金资产的 0%-40%。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	公允价值	占基金资产

		净值比例(%)		净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	478,369,420.72	28.99	555,614,380.37	32.64
交易性金融资产-基金投资	1,060,588,253.82	64.27	995,081,510.37	58.46
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	79,866.52	0.01	83,007.11	0.01
其他	-	-	-	-
合计	1,539,037,541.06	93.27	1,550,778,897.85	91.11

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

#### 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	1,538,957,674.54
第二层次	-
第三层次	-
合计	1,538,957,674.54

###### 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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 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。

#### 6.4.14.4 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。

#### 6.4.15 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	478,369,420.72	28.89
	其中: 普通股	478,369,420.72	28.89
	存托凭证	-	-
2	基金投资	995,281,547.48	60.11
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	79,866.52	0.00
	其中: 远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	79,866.52	0.00
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	65,306,706.34	3.94
7	银行存款和结算备付 金合计	98,542,999.58	5.95
8	其他资产	18,222,914.00	1.10
9	合计	1,655,803,454.64	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 27,218,824.48 元, 占基金资产净值比例 1.65%。

### 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	478,369,420.72	28.99
合计	478,369,420.72	28.99

### 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	30,978,528.00	1.88
材料	60,090,500.11	3.64
工业	16,932,162.70	1.03
非必需消费品	73,548,667.99	4.46
必需消费品	24,993,585.18	1.51
医疗保健	26,623,094.48	1.61
金融	85,186,342.10	5.16
科技	4,065,028.26	0.25
通讯	124,734,582.00	7.56
公用事业	-	-
房地产	31,216,929.90	1.89
政府	-	-
合计	478,369,420.72	28.99

注：本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

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

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Meituan	美团	3690 HK	中国香港联合交易所	中国香港	288,000	32,474,348.35	1.97
2	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	3,000,000	31,808,310.00	1.93
3	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	3,000,000	30,978,528.00	1.88
4	Tencent	腾讯控	0700	中国香	中国香	100,000	30,572,	1.85

	Holding s Ltd	股有限 公司	HK	港联合 交易所	港		856.80	
5	Kuaisho u Technol ogy	快手科 技	1024 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	600,000	29,623, 217.40	1.80
6	Hong Kong Exchan ges and Clearing Ltd.	香港交 易及结 算所有 限公司	0388 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	100,000	27,216, 849.60	1.65
7	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	3,000,0 00	25,861, 539.00	1.57
8	Alibaba Group Holding Limited	阿里巴 巴集团 控股有 限公司	9988 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	300,000	22,459, 432.80	1.36
9	Kingsof t Corpora tion Limited	金山软 件有限 公司	3888 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	750,000	21,332, 312.25	1.29
10	New China Life Insuranc e Compan y 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	1,000,0 00	19,038, 887.00	1.15
11	JD.Com , Inc.	京东集 团股份 有限公司	9618 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	150,000	18,310, 522.80	1.11
12	CGN Mining Compan y Limited	中广核 矿业有 限公司	1164 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	21,035, 000	15,709, 017.93	0.95
13	Neusoft Educati on	东软教 育科技 有限公 司	9616 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	5,685,6 00	15,463, 927.99	0.94

	Technology Co. Limited	司						
14	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	2,500,000	14,820,828.50	0.90
15	Simcere Pharmaceutical Group Limited	先声药业集团有限公司	2096 HK	中国香港联合交易所	中国香港	2,000,000	14,309,129.60	0.87
16	Aquila Acquisition Corporation	Aquila Acquisition Corporation	7836 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,575,000	13,069,066.50	0.79
17	IGG Inc	IGG Inc	0799 HK	中国香港联合交易所	中国香港	3,000,000	10,731,847.20	0.65
18	ZJLD Group Inc	珍酒李渡集团有限公司	6979 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,479,500	10,721,585.56	0.65
19	Shanghai Industrial Holdings Ltd.	上海实业控股有限公司	0363 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,000,000	10,473,692.80	0.63
20	Yankuang Energy Group Company Limited	兖矿能源集团股份有限公司	1171 HK	中国香港联合交易所	中国香港	500,000	10,349,225.50	0.63
21	Carsgen Therape	科济药业控股	2171 HK	中国香港联合交易所	中国香港	800,000	7,147,188.96	0.43



	utics Holding s Limited	有限公司		交易所				
22	Onewo Inc.	万物云空间科技服务股份有限公司	2602 HK	中国香港联合交易所	中国香港	300,000	6,997,828.20	0.42
23	Cathay Media And Education Group Inc.	华夏视听教育集团	1981 HK	中国香港联合交易所	中国香港	6,000,000	6,914,850.00	0.42
24	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	100,000	6,564,497.60	0.40
25	ESR Group Limited	ESR Group Limited	1821 HK	中国香港联合交易所	中国香港	500,000	6,195,705.60	0.38
26	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	200,000	5,577,979.00	0.34
27	Sisram Medical Ltd	复锐医疗科技股份有限公司	1696 HK	中国香港联合交易所	中国香港	600,000	5,166,775.92	0.31
28	Excellence Commercial Property & Facilities Management Group	卓越商企服务集团有限公司	6989 HK	中国香港联合交易所	中国香港	2,097,100	4,949,719.70	0.30

	Limited							
29	Man Wah Holdings Limited	敏华控股有限公司	1999 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,000,000	4,821,955.40	0.29
30	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	150,000	4,812,735.60	0.29
31	EVA Precision Industrial Holdings Ltd	亿和精密工业控股有限公司	0838 HK	中国香港联合交易所	中国香港	5,726,000	4,065,028.26	0.25
32	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	175,600	2,894,766.42	0.18
33	Midea Real Estate Holding Limited	美的置业控股有限公司	3990 HK	中国香港联合交易所	中国香港	400,000	2,599,983.60	0.16
34	China National Building Material Company Limited	中国建材股份有限公司	3323 HK	中国香港联合交易所	中国香港	500,000	2,221,971.80	0.13
35	China Conch Environment Protection Holdings	中国海螺环保控股有限公司	0587 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,000,000	2,111,334.20	0.13

	Limited							
36	Shandong Gold Mining Co., Ltd.	山东黄金矿业股份有限公司	1787 HK	中国香港联合交易所	中国香港	150	1,974.88	0.00

## 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	CITIC Limited	0267 HK	24,065,292.53	1.41
2	Morimatsu International Holdings Company Limited	2155 HK	20,077,819.98	1.18
3	New China Life Insurance Company Ltd.	1336 HK	20,038,750.28	1.18
4	Cnooc Limited	0883 HK	19,686,325.62	1.16
5	ZJLD Group Inc	6979 HK	15,080,484.40	0.89
6	IGG Inc	0799 HK	14,997,262.46	0.88
7	Simcere Pharmaceutical Group Limited	2096 HK	13,728,694.05	0.81
8	Shanghai Industrial Holdings Ltd.	0363 HK	10,920,993.18	0.64
9	Yankuang Energy Group Company Limited	1171 HK	10,531,351.94	0.62
10	Meituan	3690 HK	8,500,841.28	0.50
11	Sisram Medical Ltd	1696 HK	8,005,407.93	0.47
12	Onewo Inc.	2602 HK	7,819,367.71	0.46
13	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	7,040,541.85	0.41
14	Kingsoft Corporation Limited	3888 HK	6,948,633.75	0.41
15	Tsingtao Brewery	0168 HK	6,392,117.78	0.38

	Company Limited			
16	ESR Group Limited	1821 HK	6,076,975.19	0.36
17	JD.Com, Inc.	9618 HK	5,744,057.75	0.34
18	Tencent Holdings Ltd	0700 HK	5,670,057.52	0.33
19	Giant Biogene Holding Co., Ltd	2367 HK	4,834,917.76	0.28
20	Kuaishou Technology	1024 HK	4,748,825.42	0.28

注：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	Chongqing Hongjiu Fruit Co., Limited	6689 HK	53,902,887.28	3.17
2	China International Capital Corporation Limited	3908 HK	25,990,189.18	1.53
3	Towngas Smart Energy Company Limited	1083 HK	19,127,612.87	1.12
4	Zhou Hei Ya International Holdings Company Limited	1458 HK	16,606,973.98	0.98
5	Meituan	3690 HK	16,282,767.14	0.96
6	Ganfeng Lithium Group Co., Ltd.	1772 HK	12,037,801.19	0.71
7	Haier Smart Home Co., Ltd.	6690 HK	10,457,898.26	0.61
8	Byd Company Limited	1211 HK	10,431,319.08	0.61
9	Innovent Biologics, Inc.	1801 HK	9,809,028.95	0.58

10	CSPC Pharmaceutical Group Limited	1093 HK	7,624,227.13	0.45
11	Zhaojin Mining Industry Company Limited	1818 HK	7,600,210.12	0.45
12	Man Wah Holdings Limited	1999 HK	7,524,705.07	0.44
13	Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Limited	6989 HK	6,677,174.39	0.39
14	Wuxi Apptec Co.,Ltd.	2359 HK	6,077,873.09	0.36
15	Anhui Conch Cement Company Limited	0914 HK	5,714,868.08	0.34
16	Cathay Media And Education Group Inc.	1981 HK	5,644,955.73	0.33
17	CALB Group Co., Ltd.	3931 HK	5,273,948.75	0.31
18	Venus Medtech (Hangzhou) Inc.	2500 HK	4,669,622.59	0.27
19	Gushengtang Holdings Limited	2273 HK	4,329,380.35	0.25
20	MicroPort Scientific Corporation	0853 HK	3,746,057.96	0.22

注：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	233,245,760.38
卖出收入（成交）总额	247,360,862.80

注：买入成本和卖出收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 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

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	权证	4836 HK	79,866.52	0.00

## 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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	T Rowe Price Funds SICAV - Global Focused Growth Equity Fund	股票型基金	契约型开放式	T Rowe Price Luxembourg Management Sarl	288,237,162.00	17.47
2	Wellington Global Quality Growth Fund	股票型基金	契约型开放式	Wellington Luxembourg Sarl	278,938,279.98	16.90
3	KraneShares CSI China Internet ETF	ETF 基金	交易型开放式	Krane Funds Advisors LLC	145,943,095.50	8.84
4	Invesco China Technology ETF	ETF 基金	交易型开放式	Invesco Capital Management LLC	119,788,445.30	7.26

5	Invesco WilderHill Clean Energy ETF	ETF 基金	交易型开放式	Invesco Capital Management LLC	86,969,728.80	5.27
6	BNY Mellon U.S. Dollar Liquidity Fund	货币市场基金	契约型开放式	BNY Mellon Fund Management Luxembourg SA	65,306,706.34	3.96
7	Global X MSCI China Consumer Discretionary ETF	ETF 基金	交易型开放式	Global X Management Co LLC	32,588,358.00	1.97
8	SPDR S&P China ETF	ETF 基金	交易型开放式	State Street Global Advisors Inc	26,652,363.30	1.62
9	iShares MSCI China ETF	ETF 基金	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	16,164,114.60	0.98

## 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	13,614,974.46
2	应收清算款	-
3	应收股利	4,539,342.30
4	应收利息	-
5	应收申购款	68,597.24
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,222,914.00

#### 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
136,965	13,495.13	7,582,571.42	0.41%	1,840,778,567.12	99.59%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

### 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	754,548.91	0.0408%

### 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(2007年9月19日)基金份额总额	29,998,151,206.40
---------------------------	-------------------



本报告期期初基金份额总额	1,933,072,358.03
本报告期基金总申购份额	2,942,176.53
减：报告期基金总赎回份额	87,653,396.02
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,848,361,138.54

## § 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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	-	187,107,282.39	38.93%	440,392.48	28.70%	-
UBS Securities Asia Limited	-	72,185,736.24	15.02%	167,790.05	10.93%	-
BOCI Securities Limited	-	65,259,395.27	13.58%	65,259.41	4.25%	-
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	38,951,381.06	8.10%	38,951.37	2.54%	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	37,584,469.14	7.82%	368,784.99	24.03%	-
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	-	32,501,006.07	6.76%	167,737.61	10.93%	-
Haitong International Securities Co.,Ltd	-	27,162,990.00	5.65%	169,766.22	11.06%	-
China Merchants Securities(HK)Co Ltd	-	7,780,528.59	1.62%	11,670.81	0.76%	-

Guotai Junan (Hong Kong) Limited	-	7,414,687.70	1.54%	8,897.62	0.58%	-
GuangFa Securities (Hong Kong) Business Limited	-	4,659,146.88	0.97%	95,372.67	6.21%	-

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总	成交金额	占当期基金成交总

		额的比例		交总额的 比例		额的比例		额的比例
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	235,021,5 30.08	44.72%
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	67,532,43 4.30	12.85%
BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China Internatio nal Capital Corporati on Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia)L.L. C	-	-	-	-	-	-	3,147,446. 29	0.60%
Haitong Internatio nal Securities Co.,Ltd	-	-	-	-	-	-	148,131,9 83.79	28.19%
China Merchants Securities (HK)Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-

Guotai Junan (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
GuangFa Securities (Hong Kong) Business Limited	-	-	-	-	-	-	-	71,711,999.93	13.65%

注：券商选择标准和程序：

为保障公司境外证券投资的顺利开展，规范券商选择及交易量分配标准与原则，基金管理人明确了券商选择、考核及交易量的分配等流程。

#### A. 券商的选择

券商的交易及清算执行能力、研究实力和提供的研究服务等，这是选择券商以及分配交易量最主要的原则和标准，包括以下几个方面：

交易及清算执行能力。主要指券商是否对投资指令进行了有效的执行、能否取得较高质量的成交结果以及成交以后的清算完成情况。衡量交易执行能力的指标主要有：是否完成交易、成交的及时性、成交价格、对市场的影响、清算系统的能力与清算时效性等；

研究机构的实力和水平。主要是指券商能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告，报告内容是否详实，投资建议是否准确；

提供研究服务的质量。主要指券商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。

其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

#### B. 券商交易量分仓

公司将定期根据交易执行能力、研究机构的实力和水平、提供专业服务的质量等标准对交易券商进行打分考核，并根据考核结果拟定下期的交易量分配。

## 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	南方基金管理股份有限公司关于凤凰金信（海口）基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	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	2023-03-13
2	南方基金管理股份有限公司关于凤凰金信（海口）基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	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	2023-03-16

## § 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全球精选配置证券投资基金的文件；
- 2、《南方全球精选配置证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方全球精选配置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、《南方全球精选配置证券投资基金 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>