

南方利达灵活配置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：北京银行股份有限公司

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。

基金托管人北京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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 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.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息.....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
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.....	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
§12 备查文件目录.....	46
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方利达灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	南方利达灵活配置混合	
基金主代码	001566	
交易代码	001566	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 7 月 8 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	157,398,533.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方利达灵活配置混合 A	南方利达灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	001566	001567
报告期末下属分级基金的份 额总额	92,743,843.83 份	64,654,690.03 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，通过专业化研究分析及投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：人民币三年期定期存款利率（税后）+2%。人民币三年期定期存款利率以中国人民银行公布的金融机构人民币三年期存款基准利率为准。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	史学通
	联系电话	010-66223413
	电子邮箱	shixuetong@bankofbeijing.com.cn
	manager@southernfund.com	

客户服务电话	400-889-8899	95526
传真	0755-82763889	010-89661115
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	北京市西城区金融大街甲 17 号首层
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	北京市西城区金融大街丙 17 号
邮政编码	518017	100033
法定代表人	周易	霍学文

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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、南方利达灵活配置混合 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	1,416,222.79
本期利润	2,187,108.49
加权平均基金份额本期利润	0.0181
本期加权平均净值利润率	1.35%
本期基金份额净值增长率	0.38%
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	15,620,540.56
期末可供分配基金份额利润	0.1684
期末基金资产净值	123,009,537.92
期末基金份额净值	1.326
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	54.67%
-------------	--------

2、南方利达灵活配置混合 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	781,384.70
本期利润	631,009.51
加权平均基金份额本期利润	0.0085
本期加权平均净值利润率	0.64%
本期基金份额净值增长率	0.30%
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	20,708,021.11
期末可供分配基金份额利润	0.3202
期末基金资产净值	85,362,711.14
期末基金份额净值	1.320
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	37.14%

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；

4、本基金从 2015 年 11 月 12 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2015 年 11 月 12 日起存续。

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

南方利达灵活配置混合 A

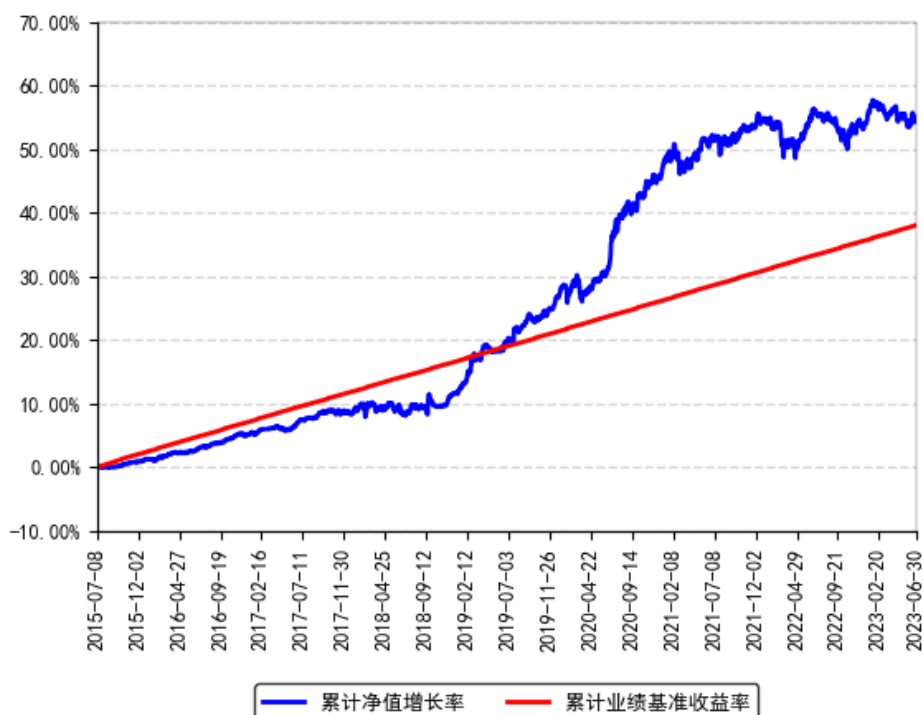
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.76%	0.28%	0.28%	0.01%	0.48%	0.27%
过去三个月	-0.67%	0.24%	0.87%	0.01%	-1.54%	0.23%
过去六个月	0.38%	0.23%	1.74%	0.02%	-1.36%	0.21%
过去一年	-1.04%	0.25%	3.56%	0.02%	-4.60%	0.23%
过去三年	17.51%	0.30%	11.51%	0.01%	6.00%	0.29%
自基金合同生效起至今	54.67%	0.24%	38.04%	0.01%	16.63%	0.23%

南方利达灵活配置混合 C

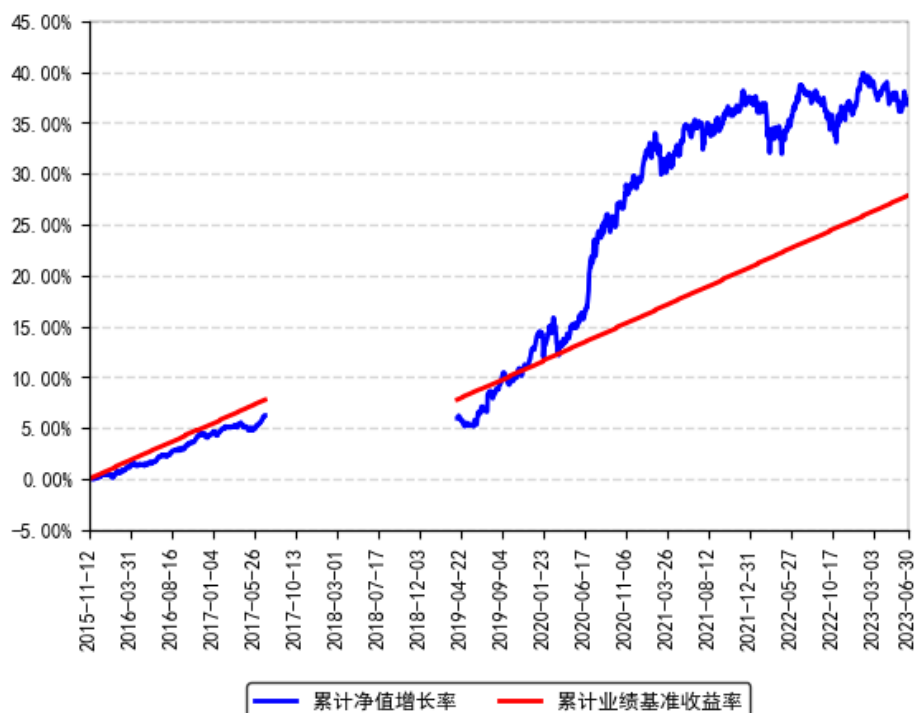
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.76%	0.27%	0.31%	0.01%	0.45%	0.26%
过去三个月	-0.68%	0.24%	0.93%	0.01%	-1.61%	0.23%
过去六个月	0.30%	0.23%	1.88%	0.02%	-1.58%	0.21%
过去一年	-1.12%	0.25%	3.86%	0.02%	-4.98%	0.23%
过去三年	17.11%	0.30%	12.54%	0.01%	4.57%	0.29%
自基金合同 生效起至今	37.14%	0.24%	27.85%	0.01%	9.29%	0.23%

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

南方利达灵活配置混合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



南方利达灵活配置混合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：1、本基金从 2015 年 11 月 12 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2015 年 11 月 12 日起存续。

2、本基金 C 级份额相关数据和指标按投资者实际持有份额的期间计算。

§ 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		
吴剑毅	本基金基金经理	2015 年 7 月 8 日	-	13 年	清华大学金融学硕士，具有基金从业资格。2009 年 7 月加入南方基金，任南方基金研究部金融行业研究员；2012 年 3 月 15 日至 2014 年 7 月 18 日，担任南方避险、南方保本基金经理助理；2015 年 11 月 26 日至 2017 年 12 月 2 日，任南方顺康保本基金经理；2014 年 7 月 18 日至 2018 年 1 月 16 日，任南方恒元基金经理；2015 年 9 月 11 日至 2018 年 11 月 28 日，任南方消费活力基金经理；2015 年 10 月 28 日至 2018 年 11 月 3 日，任南方顺达保本基金经理；2017 年 8 月 3 日至 2019 年 1 月 25 日，任南方金融混合基金经理；2017 年 12 月 2 日至 2020 年 5 月 15 日，任南方顺康混合基金经理；2018 年 2 月 6 日至 2020 年 5 月 15 日，任南方安养混合基金经理；2019 年 1 月 25 日至 2022 年 1 月 5 日，任南方新蓝筹混合基金经理；2015 年 5 月 21 日至今，任南方利众基金经理；2015 年 7 月 8 日至今，任南方利达基金经理；2015 年 11 月 19 日至今，任南方利安基金经理；2016 年 12 月 14 日至今，任南方安颐混合基金经理；2017 年 11 月 2 日至今，任南方安福混合基金经理；2018 年 11 月 3 日至今，任南方中小盘成长股票基金经理；2020 年 4 月 29 日至今，任南方誉慧一年混合基金经理；2020 年 11 月 18 日至今，任南方誉鼎一年持有期混合基金经理；2022 年 8 月 2 日至今，任南方宝祥混合基金经理。
姚万宁	本基金基金经理助理	2015 年 11 月 23 日	-	10 年	深圳大学金融学硕士，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入南方基金，担任投资部投资账户助理；2015 年 11 月 27 日至 2017 年 12 月 2 日，任南方顺康保本的基金经理助理；2015 年 11 月 23 日至 2018 年 1 月 16 日，任南方恒元的基金经理助理；2015 年 11 月 23 日至 2018 年 11 月 3 日，任南方顺达保本的基金经理助理；2015 年 11 月 23 日至今，任南方利众、南方利达、南方利安的基金经理助

					理；2016 年 12 月 23 日至今，任南方安颐混合的基金经理助理；2017 年 12 月 2 日至今，任南方顺康混合的基金经理助理；2018 年 1 月 16 日至今，任南方中证 100 的基金经理助理；2018 年 11 月 3 日至今，任南方中小盘成长股票的基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

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

本基金主要基于预期收益率进行组合资产的配置和再平衡：即根据预期收益率高低确定各项资产在组合中的权重占比，过程中持续增加预期收益率提升的资产权重，相应降低预期收益率下降的资产权重。该方法适用于股票、债券以及股债之间的大类资产配置。对于债券资产而言，预期收益率是相对清晰的，我们在债券收益率上行时倾向于提升配置，反之亦然。相比之下，股票的预期收益率则没有那么清晰，它要求我们对各家公司远期的目标市值有一个相对明确的价值判断，从而与当前市值进行比较得出预期收益率。对远期市值的评估需要考验我们对各家公司未来的洞见，这是一件难而正确的事情，我们始终朝这个方向在努力。

我们的价值观决定了我们将始终深耕于那些长期 ROE 稳定较高且可持续的优质公司：因为这些公司的商业模式相对稳定，竞争格局相对清晰，从而对预期收益率的判断是相对容易的。与之相对应的，我们较少地参与到市场上的主题投资或者趋势投资，因为我们无法确保每次对于方向的判断都是正确的。而基于预期收益率基础上的价值投资方式，则确保我们始终站在时间的一边，价值的一边。我们始终相信，股票投资不是毕其功于一役，而是长时间的细水长流。

回顾上半年，受经济复苏进度低于预期的影响，与经济相关度较高的优质公司整体表现疲弱，而数字经济、高股息等主题投资表现则相对亮眼。我们以茅指数代表长期高 ROE 的优质公司集合，以中证 1000 代表流动性驱动的中小市值公司，可以发现，上半年茅指数下跌 3.84%，而中证 1000 则上涨 5.10%——优质公司的表现非常“逆风”，大幅跑输市场。

在此背景下，我们的股票组合表现也同样“逆风”。但在此过程中，我们始终基于预期收益率进行动态再平衡：我们降低了涨幅较大的计算机、半导体等公司的权重，而持续增加了长期基本面向好、短期下跌较多的消费、医药、新能源方向的优质公司权重。

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 1.326 元，报告期内，份额净值增长率为 0.38%，同期业绩基准增长率为 1.74%；本基金 C 份额净值为 1.320 元，报告期内，份额净值增长率为 0.30%，同期业绩基准增长率为 1.88%。

4.5 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，在经济复苏的过程中，短期有所波折是正常的，不应该仅仅因为短期数据转弱而否定了未来的复苏趋势。相反，短期市场的过度反应，反而使得不少优质公司因为股价的下跌，未来的预期收益率大幅提升。虽然我们无法准确预知经济数据何时能够好转，但我们对中国经济的强大韧性以及决策层的战略眼光充满信心，持续攀升的居民储蓄将成为未来经济复苏的重要驱动力量。更为重要的一点是，股价表现大概率将领先基本面。巴菲特曾经举例：大萧条时期经济状况持续恶化，直到 1933 年 3 月罗斯福就任总统时才改善，而当时股市从低点已经反弹了 30%；再如二战时期，等到盟军真正获胜时，股市早已大

幅反弹。因此，不要浪费了短期市场的极端行情，应该借此积极布局优质公司，虽然当下他们的短期数据可能不好，静态估值可能很贵，但这个时候才能真正以便宜的价格买到好公司，陪伴他们一起“逆风翱翔”，静待花开。

固定收益方面，基于当前收益率已处于近 3 年来的低位，而短期汇率压力、长期经济复苏动能都制约了收益率进一步下行的空间，我们对债券保持谨慎态度，耐心等待收益率上行后的配置机会。未来我们将在努力保持持仓品种的安全性和流动性的基础上，获取相对稳定的票息收益。

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

在本报告期内，本基金托管人在托管南方利达灵活配置混合型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

在本报告期内，本托管人复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容，保证复核内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方利达灵活配置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	6.4.3.1	2,281,418.56	2,555,646.42
结算备付金		1,059,158.34	1,795,584.46
存出保证金		64,396.41	122,439.64
交易性金融资产	6.4.3.2	239,233,413.00	387,080,327.45
其中：股票投资		53,199,728.12	73,283,237.82
基金投资		-	-
债券投资		186,033,684.88	313,797,089.63
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
债权投资		-	-
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		103,888.46	575,647.63
应收股利		-	-
应收申购款		31,675.90	98,248.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		242,773,950.67	392,227,894.40
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		33,009,597.49	34,016,358.91
应付清算款		754,065.65	-
应付赎回款		309,760.00	322,909.08
应付管理人报酬		138,160.30	248,919.60
应付托管费		34,540.09	62,229.89
应付销售服务费		7,074.06	9,855.27
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10,651.52	26,122.30
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	137,852.50	297,345.83
负债合计		34,401,701.61	34,983,740.88
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	157,398,533.86	270,746,692.94
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	50,973,715.20	86,497,460.58
净资产合计		208,372,249.06	357,244,153.52
负债和净资产总计		242,773,950.67	392,227,894.40

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，南方利达灵活配置混合 A 份额净值 1.326 元，基金份额总额 92,743,843.83 份；南方利达灵活配置混合 C 份额净值 1.320 元，基金份额总额 64,654,690.03 份；总份额合计 157,398,533.86 份。

6.2 利润表

会计主体：南方利达灵活配置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	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		4,636,090.50	3,865,316.90
1.利息收入		63,588.65	187,895.07
其中：存款利息收入	6.4.3.9	18,187.50	40,507.28
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		45,401.15	147,387.79
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,887,135.71	7,533,455.85
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-282,527.24	-4,960,276.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	3,288,458.56	11,155,354.72
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.12	-	-
股利收益	6.4.3.13	881,204.39	1,338,377.36
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.14	620,510.51	-3,871,625.94
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.15	64,855.63	15,591.92
减：二、营业总支出		1,817,972.50	4,433,114.88
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	1,044,226.47	2,681,029.38
2.托管费	6.4.6.2.2	261,056.64	670,257.42
3.销售服务费	6.4.6.2.3	49,113.12	73,634.56
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		350,592.18	868,924.45
其中：卖出回购金融资产		350,592.18	868,924.45

支出			
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		8,214.97	21,796.22
8.其他费用	6.4.3.16	104,769.12	117,472.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,818,118.00	-567,797.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,818,118.00	-567,797.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,818,118.00	-567,797.98

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方利达灵活配置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）	270,746,692.94	-	86,497,460.58	357,244,153.52
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）	270,746,692.94	-	86,497,460.58	357,244,153.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-113,348,159.08	-	-35,523,745.38	-148,871,904.46
（一）、综合收益总额	-	-	2,818,118.00	2,818,118.00
（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）	-113,348,159.08	-	-38,341,863.38	-151,690,022.46
其中：1.基金申购款	42,395,893.04	-	14,419,316.95	56,815,209.99
2.基金赎回款	-155,744,052.12	-	-52,761,180.33	-208,505,232.45

(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)	157,398,533.86	-	50,973,715.20	208,372,249.06
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)	627,891,017.40	-	205,675,031.74	833,566,049.14
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)	627,891,017.40	-	205,675,031.74	833,566,049.14
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-227,908,509.21	-	-70,233,278.47	-298,141,787.68
(一)、综合收益总额	-	-	-567,797.98	-567,797.98
(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)	-227,908,509.21	-	-69,665,480.49	-297,573,989.70
其中: 1.基金申购款	27,097,793.60	-	8,561,095.79	35,658,889.39
2.基金赎回款	-255,006,302.81	-	-78,226,576.28	-333,232,879.09
(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)	399,982,508.19	-	135,441,753.27	535,424,261.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____杨小松____ ____徐超____ ____徐超____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	2,281,418.56
等于：本金	2,281,156.60
加：应计利息	261.96
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	2,281,418.56

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	61,358,682.23	-	53,199,728.12	-8,158,954.11
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	1,643,553.21	93,935,418.01	-281,911.47
	银行间市场	90,821,406.28	92,098,266.87	156,593.72
	合计	183,395,182.55	2,763,820.08	186,033,684.88
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	244,753,864.78	2,763,820.08	239,233,413.00	-8,284,271.86

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.3.6 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	178.48
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	53,371.46
其中：交易所市场	53,021.46
银行间市场	350.00
应付利息	-
预提费用	84,302.56
其他	-
合计	137,852.50

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方利达灵活配置混合 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	182,829,117.18	182,829,117.18
本期申购	31,324,250.62	31,324,250.62
本期赎回（以“-”号填列）	-121,409,523.97	-121,409,523.97
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	92,743,843.83	92,743,843.83

南方利达灵活配置混合 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	87,917,575.76	87,917,575.76
本期申购	11,071,642.42	11,071,642.42
本期赎回（以“-”号填列）	-34,334,528.15	-34,334,528.15
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	64,654,690.03	64,654,690.03

注：

申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

南方利达灵活配置混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,761,553.06	29,960,847.66	58,722,400.72
本期利润	1,416,222.79	770,885.70	2,187,108.49

本期基金份额交易产生的变动数	-14,557,235.29	-16,086,579.83	-30,643,815.12
其中：基金申购款	5,081,712.35	5,568,922.16	10,650,634.51
基金赎回款	-19,638,947.64	-21,655,501.99	-41,294,449.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,620,540.56	14,645,153.53	30,265,694.09

南方利达灵活配置混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,578,367.02	196,692.84	27,775,059.86
本期利润	781,384.70	-150,375.19	631,009.51
本期基金份额交易产生的变动数	-7,412,797.91	-285,250.35	-7,698,048.26
其中：基金申购款	3,512,664.66	256,017.78	3,768,682.44
基金赎回款	-10,925,462.57	-541,268.13	-11,466,730.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,946,953.81	-238,932.70	20,708,021.11

6.4.3.9 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	6,344.92
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	10,811.43
其他	1,031.15
合计	18,187.50

6.4.3.10 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	79,457,742.99
减：卖出股票成本总额	79,522,036.40
减：交易费用	218,233.83
买卖股票差价收入	-282,527.24

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.11 债券投资收益

6.4.3.11.1 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	3,169,530.46

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	118,928.10
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	3,288,458.56

6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	142,883,840.74
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	140,678,415.66
减：应计利息总额	2,084,921.98
减：交易费用	1,575.00
买卖债券差价收入	118,928.10

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.3.12 衍生工具收益

6.4.3.12.1 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。

6.4.3.12.2 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。

6.4.3.13 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	881,204.39
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	881,204.39

6.4.3.14 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	620,510.51
——股票投资	-207,039.27
——债券投资	827,549.78
——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	620,510.51

6.4.3.15 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	64,786.77
基金转换费收入	68.86
合计	64,855.63

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中，A 类份额将不低于赎回费总额的 50% 归入基金资产，C 类份额将赎回费收入全额归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中，A 类基金份额将不低于转出基金的赎回费的 50% 归入转出基金的基金资产，C 类基金份额将转出基金的赎回费全额归入转出基金的基金资产。

6.4.3.16 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	18,600.00
银行费用	1,866.56
合计	104,769.12

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	基金管理人、登记机构、基金销售机构
北京银行股份有限公司("北京银行")	基金托管人、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

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。

6.4.6.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.3 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。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,044,226.47	2,681,029.38
其中：支付销售机构的客户维护费	196,965.05	303,670.64

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 0.80% 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 × 0.80% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
----	------------------------------------	---

当期发生的基金应支付的托管费	261,056.64	670,257.42
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人北京银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

6.4.6.2.3 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		
	南方利达灵活配置混合 A	南方利达灵活配置混合 C	合计
南方基金	-	17,661.17	17,661.17
合计	-	17,661.17	17,661.17
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方利达灵活配置混合 A	南方利达灵活配置混合 C	合计
南方基金	-	27,299.10	27,299.10
合计	-	27,299.10	27,299.10

注：根据《南方基金关于旗下部分混合型基金销售服务费优惠的公告》和《南方基金关于继续开展旗下部分基金销售服务费优惠的公告》，自 2015 年 11 月 13 日起，销售服务费率调整为 0.10%，调整后，支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，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 × 0.10% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.6.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
北京银行	2,281,418.56	6,344.92	2,988,646.50	9,535.54

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	118031	天 23 转债	配债	110	11,000.00
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	688048	长光华芯	网下申购	4,428	357,782.40
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	5,352	304,421.76
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	12,070	271,937.10
华泰联合	110085	通 22 转债	配债	1,560	156,000.00
华泰联合	123145	药石转债	配债	213	21,300.00

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 33,009,597.49 元, 截至 2023 年 7 月 5 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金, 预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金, 低于股票基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内, 使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会, 负责制定风险管理的宏观政策, 审议通过风险控制的总体措施等, 在管理层层面设立风险控制委员会, 讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施, 在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽

核部和风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估,督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.9.2 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北京银行,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。

6.4.9.3 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。

于本报告期末,除卖出回购金融资产款余额中有 33,009,597.49 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外,本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月

以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.1 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。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大,此外还持有银行存款、结算备付金和存出保证金等利率敏感性资产,因此存在相应的利率风险。

6.4.9.4.1.1 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	2,281,418.56	-	-	-	2,281,418.56
结算备付金	1,059,158.34	-	-	-	1,059,158.34
存出保证金	64,396.41	-	-	-	64,396.41
交易性金融资产	72,620,017.4 2	113,413,667. 46	-	53,199,728.1 2	239,233,413. 00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	103,888.46	103,888.46
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	31,675.90	31,675.90
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	76,024,990.7 3	113,413,667. 46	-	53,335,292.4 8	242,773,950. 67
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	33,009,597.4 9	-	-	-	33,009,597.4 9
应付清算款	-	-	-	754,065.65	754,065.65
应付赎回款	-	-	-	309,760.00	309,760.00

应付管理人报酬	-	-	-	138,160.30	138,160.30
应付托管费	-	-	-	34,540.09	34,540.09
应付销售服务费	-	-	-	7,074.06	7,074.06
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	10,651.52	10,651.52
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	137,852.50	137,852.50
负债总计	33,009,597.49	-	-	1,392,104.12	34,401,701.61
利率敏感度缺口	43,015,393.24	113,413,667.46	-	51,943,188.36	208,372,249.06
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	2,555,646.42	-	-	-	2,555,646.42
结算备付金	1,795,584.46	-	-	-	1,795,584.46
存出保证金	122,439.64	-	-	-	122,439.64
交易性金融资产	71,433,584.12	242,363,505.51	-	73,283,237.82	387,080,327.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	575,647.63	575,647.63
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	98,248.80	98,248.80
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	75,907,254.64	242,363,505.51	-	73,957,134.25	392,227,894.40
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	34,016,358.9 1	-	-	-	34,016,358.9 1
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	322,909.08	322,909.08
应付管理人 报酬	-	-	-	248,919.60	248,919.60
应付托管费	-	-	-	62,229.89	62,229.89
应付销售服 务费	-	-	-	9,855.27	9,855.27
应付投资顾 问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	26,122.30	26,122.30
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税 负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	297,345.83	297,345.83
负债总计	34,016,358.9 1	-	-	967,381.97	34,983,740.8 8
利率敏感度 缺口	41,890,895.7 3	242,363,505. 51	-	72,989,752.2 8	357,244,153. 52

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.9.4.1.2 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	-639,077.40	-1,178,030.43
	2.市场利率平行下降25个基点	645,327.69	1,186,395.06

6.4.9.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 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。本基金股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例范围 0-95%；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)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 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	53,199,728.12	25.53	73,283,237.82	20.51
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	53,199,728.12	25.53	73,283,237.82	20.51

6.4.9.4.3.2 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%	2,822,747.16	3,959,016.28

2.沪深 300 下降 5%	-2,822,747.16	-3,959,016.28
----------------	---------------	---------------

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	63,806,822.96
第二层次	175,426,590.04
第三层次	-
合计	239,233,413.00

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 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。

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	53,199,728.12	21.91
	其中：股票	53,199,728.12	21.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	186,033,684.88	76.63
	其中：债券	186,033,684.88	76.63
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,340,576.90	1.38
8	其他资产	199,960.77	0.08
9	合计	242,773,950.67	100.00

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	434,988.00	0.21
B	采矿业	1,326,654.00	0.64
C	制造业	31,625,346.55	15.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	165,675.00	0.08
E	建筑业	1,092,322.00	0.52
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,184,162.00	0.57
H	住宿和餐饮业	749,418.00	0.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,919,449.40	0.92
J	金融业	8,007,488.42	3.84
K	房地产业	1,904,342.00	0.91
L	租赁和商务服务业	1,673,352.00	0.80
M	科学研究和技术服务业	2,708,338.00	1.30
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	408,192.75	0.20

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	53,199,728.12	25.53

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	601166	兴业银行	147,700	2,311,505.00	1.11
2	000001	平安银行	152,274	1,710,037.02	0.82
3	600519	贵州茅台	1,000	1,691,000.00	0.81
4	601888	中国中免	14,400	1,591,632.00	0.76
5	300750	宁德时代	6,260	1,432,225.40	0.69
6	600887	伊利股份	49,975	1,415,292.00	0.68
7	601012	隆基绿能	48,552	1,391,985.84	0.67
8	002049	紫光国微	14,500	1,352,125.00	0.65
9	600741	华域汽车	72,514	1,338,608.44	0.64
10	603259	药明康德	21,200	1,320,972.00	0.63
11	600176	中国巨石	92,101	1,304,150.16	0.63
12	600346	恒力石化	88,800	1,272,504.00	0.61
13	600585	海螺水泥	52,800	1,253,472.00	0.60
14	600660	福耀玻璃	34,300	1,229,655.00	0.59
15	000002	万科 A	84,900	1,190,298.00	0.57
16	000733	振华科技	12,000	1,150,200.00	0.55
17	601668	中国建筑	190,300	1,092,322.00	0.52
18	601877	正泰电器	39,030	1,079,179.50	0.52
19	000333	美的集团	17,700	1,042,884.00	0.50
20	688599	天合光能	24,081	1,026,091.41	0.49
21	000776	广发证券	67,000	985,570.00	0.47
22	002466	天齐锂业	13,800	964,758.00	0.46
23	300014	亿纬锂能	15,500	937,750.00	0.45
24	300059	东方财富	65,292	927,146.40	0.44
25	002415	海康威视	28,000	927,080.00	0.44
26	600809	山西汾酒	5,000	925,350.00	0.44
27	601318	中国平安	17,500	812,000.00	0.39
28	300759	康龙化成	20,900	800,052.00	0.38
29	300454	深信服	6,700	758,775.00	0.36
30	002475	立讯精密	23,100	749,595.00	0.36
31	600754	锦江酒店	17,700	749,418.00	0.36
32	000858	五粮液	4,500	736,065.00	0.35

33	600048	保利发展	54,800	714,044.00	0.34
34	002410	广联达	20,560	667,994.40	0.32
35	002352	顺丰控股	14,800	667,332.00	0.32
36	002311	海大集团	13,700	641,708.00	0.31
37	300122	智飞生物	13,550	598,910.00	0.29
38	002812	恩捷股份	6,100	587,735.00	0.28
39	300347	泰格医药	9,100	587,314.00	0.28
40	600132	重庆啤酒	6,300	580,608.00	0.28
41	002142	宁波银行	20,000	506,000.00	0.24
42	603833	欧派家居	5,200	498,160.00	0.24
43	603517	绝味食品	13,292	493,797.80	0.24
44	300751	迈为股份	2,900	491,202.00	0.24
45	600031	三一重工	29,500	490,585.00	0.24
46	600188	兖矿能源	15,500	463,760.00	0.22
47	002714	牧原股份	10,320	434,988.00	0.21
48	300661	圣邦股份	5,200	427,076.00	0.20
49	601899	紫金矿业	37,000	420,690.00	0.20
50	300015	爱尔眼科	22,005	408,192.75	0.20
51	300760	迈瑞医疗	1,331	399,033.80	0.19
52	300438	鹏辉能源	7,700	369,908.00	0.18
53	603606	东方电缆	7,200	353,016.00	0.17
54	601111	中国国航	41,500	341,960.00	0.16
55	300450	先导智能	9,400	339,998.00	0.16
56	601225	陕西煤业	14,800	269,212.00	0.13
57	002179	中航光电	5,680	257,588.00	0.12
58	600030	中信证券	13,000	257,140.00	0.12
59	600588	用友网络	12,200	250,100.00	0.12
60	603806	福斯特	6,720	249,916.80	0.12
61	002841	视源股份	3,700	247,308.00	0.12
62	601838	成都银行	20,200	246,642.00	0.12
63	600941	中国移动	2,600	242,580.00	0.12
64	600029	南方航空	29,000	174,870.00	0.08
65	603501	韦尔股份	1,765	173,040.60	0.08
66	600028	中国石化	27,200	172,992.00	0.08
67	600522	中天科技	10,600	168,646.00	0.08
68	300628	亿联网络	4,800	168,336.00	0.08
69	601601	中国太保	6,400	166,272.00	0.08
70	601985	中国核电	23,500	165,675.00	0.08
71	002271	东方雨虹	6,000	163,560.00	0.08
72	000661	长春高新	1,200	163,560.00	0.08
73	603986	兆易创新	1,500	159,375.00	0.08
74	600745	闻泰科技	3,000	146,700.00	0.07
75	688008	澜起科技	1,490	85,555.80	0.04

76	600036	招商银行	2,600	85,176.00	0.04
77	000938	紫光股份	2,600	82,810.00	0.04
78	002027	分众传媒	12,000	81,720.00	0.04
79	603195	公牛集团	700	67,242.00	0.03

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	601888	中国中免	2,272,515.00	0.64
2	300014	亿纬锂能	1,887,645.00	0.53
3	002049	紫光国微	1,686,459.00	0.47
4	000002	万科 A	1,659,659.00	0.46
5	688599	天合光能	1,642,251.08	0.46
6	002415	海康威视	1,462,647.00	0.41
7	300759	康龙化成	1,434,283.00	0.40
8	000733	振华科技	1,239,590.00	0.35
9	600132	重庆啤酒	1,169,198.00	0.33
10	603259	药明康德	1,115,316.00	0.31
11	601166	兴业银行	1,086,904.00	0.30
12	600809	山西汾酒	1,085,195.00	0.30
13	000333	美的集团	1,083,554.00	0.30
14	002475	立讯精密	1,080,549.00	0.30
15	300496	中科创达	1,021,702.00	0.29
16	601838	成都银行	1,021,568.00	0.29
17	002410	广联达	975,302.00	0.27
18	600754	锦江酒店	959,776.00	0.27
19	603517	绝味食品	942,817.00	0.26
20	300347	泰格医药	937,063.00	0.26

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	300750	宁德时代	2,484,389.00	0.70
2	000333	美的集团	2,396,356.00	0.67
3	000001	平安银行	2,341,047.94	0.66
4	600519	贵州茅台	2,206,610.00	0.62
5	601166	兴业银行	2,177,899.00	0.61

6	600741	华域汽车	1,740,040.00	0.49
7	002415	海康威视	1,659,511.00	0.46
8	002475	立讯精密	1,658,038.00	0.46
9	601012	隆基绿能	1,657,443.00	0.46
10	601899	紫金矿业	1,570,160.00	0.44
11	600522	中天科技	1,564,800.00	0.44
12	601877	正泰电器	1,386,910.00	0.39
13	300014	亿纬锂能	1,345,811.00	0.38
14	600176	中国巨石	1,337,474.00	0.37
15	002459	晶澳科技	1,284,697.00	0.36
16	603259	药明康德	1,246,646.00	0.35
17	600346	恒力石化	1,240,552.00	0.35
18	300274	阳光电源	1,228,945.00	0.34
19	002271	东方雨虹	1,219,953.00	0.34
20	603501	韦尔股份	1,218,481.65	0.34

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	59,645,565.97
卖出股票收入（成交）总额	79,457,742.99

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	1,221,574.68	0.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,619,843.84	24.77
	其中：政策性金融债	10,300,520.55	4.94
4	企业债券	61,510,800.55	29.52
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	61,074,370.97	29.31
7	可转债（可交换债）	10,607,094.84	5.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	186,033,684.88	89.28

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	110059	浦发转债	98,130	10,607,094.84	5.09
2	2128002	21 工商银行二级 01	100,000	10,497,443.84	5.04
3	112729	18 申宏 02	100,000	10,376,167.12	4.98
4	188343	21 国电 02	100,000	10,342,750.69	4.96
5	175988	21 国君 G2	100,000	10,323,287.67	4.95

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

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

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

无。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、国家外汇管理局上海市分局的处罚；国泰君安证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行上海分行的处罚；中国交通建设股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京外汇管理部的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	64,396.41
2	应收清算款	103,888.46
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	31,675.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	199,960.77

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	10,607,094.84	5.09

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
南方利达灵活配置混合 A	8,379	11,068.61	55,994,987.28	60.38%	36,748,856.55	39.62%
南方利达灵活配置混合 C	5,101	12,674.90	30,653,040.93	47.41%	34,001,649.10	52.59%
合计	13,480	11,676.45	86,648,028.21	55.05%	70,750,505.65	44.95%

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	南方利达灵活配置混合 A	100,055.16	0.1079%
	南方利达灵活配置混合 C	1.51	0.0000%
	合计	100,056.67	0.0636%

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	南方利达灵活配置混合 A	0
	南方利达灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放	南方利达灵活配置混合 A	10~50

式基金	南方利达灵活配置混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方利达灵活配置混合 A	南方利达灵活配置混合 C
基金合同生效日(2015年7月8日)基金份额总额	1,685,721,406.28	-
本报告期期初基金份额总额	182,829,117.18	87,917,575.76
本报告期基金总申购份额	31,324,250.62	11,071,642.42
减：报告期基金总赎回份额	121,409,523.97	34,334,528.15
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	92,743,843.83	64,654,690.03

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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	
中信建投	2	138,771,650.08	100.00%	127,511.81	100.00%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

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
中信建投	62,431,914.83	100.00%	1,386,200,000.00	100.00%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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可转换公司债券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-16
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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-13
3	南方基金关于旗下部分基金增加蒙商银行作为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-15
4	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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-16
5	南方基金关于旗下部分基金增加中山证券为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-21
6	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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-22
7	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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
8	南方基金关于旗下部分基金增加蚂蚁基金为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-06
9	南方基金关于旗下部分基金增加广发证券为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-18
10	南方基金关于旗下部分基金增加平安银行为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-18
11	南方基金关于旗下部分基金增加基煜基金为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会	2023-05-24

		基金电子披露网站	
--	--	----------	--

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101-20230206	59,964,317.30	-	59,964,317.30	-	-
机构	2	20230315-20230630	33,541,125.33	4,048,008.26	1,000,000.00	36,589,133.59	23.25%

产品特有风险

本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

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利达灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方利达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方利达灵活配置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、《南方利达灵活配置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>