

南方价值臻选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：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

§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.....	17
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	55
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.....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55

7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
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.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方价值臻选混合型证券投资基金	
基金简称	南方价值臻选混合	
基金主代码	012426	
交易代码	012426	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 21 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	421,312,615.07 份	
基金合同存续期		
下属分级基金的基金简称	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C
下属分级基金的交易代码	012426	012427
报告期末下属分级基金的份 额总额	399,983,297.84 份	21,329,317.23 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，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金依托于基金管理人的投资研究平台，紧密跟踪中国经济转型的发展方向，精选质地优秀、具备长期价值增长潜力的公司。股票投资采用定量和定性分析相结合的策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+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×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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
		郭明
		010-66105799
		custody@icbc.com.cn

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 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、南方价值臻选混合 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	-4,091,094.55
本期利润	7,877,148.59
加权平均基金份额本期利润	0.0189
本期加权平均净值利润率	2.03%
本期基金份额净值增长率	1.91%
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	-33,362,934.73
期末可供分配基金份额利润	-0.0834
期末基金资产净值	366,620,363.11
期末基金份额净值	0.9166
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	-8.34%
-------------	--------

2、南方价值臻选混合 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	-266,135.54
本期利润	348,048.60
加权平均基金份额本期利润	0.0161
本期加权平均净值利润率	1.74%
本期基金份额净值增长率	1.60%
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	-2,015,345.87
期末可供分配基金份额利润	-0.0945
期末基金资产净值	19,313,971.36
期末基金份额净值	0.9055
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	-9.45%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方价值臻选混合 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	1.20%	0.72%	1.21%	0.44%	-0.01%	0.28%
过去三个月	-2.34%	0.63%	-1.47%	0.41%	-0.87%	0.22%
过去六个月	1.91%	0.64%	0.76%	0.42%	1.15%	0.22%
过去一年	-5.77%	0.76%	-4.52%	0.51%	-1.25%	0.25%
自基金合同生效起至今	-8.34%	0.80%	-8.95%	0.57%	0.61%	0.23%

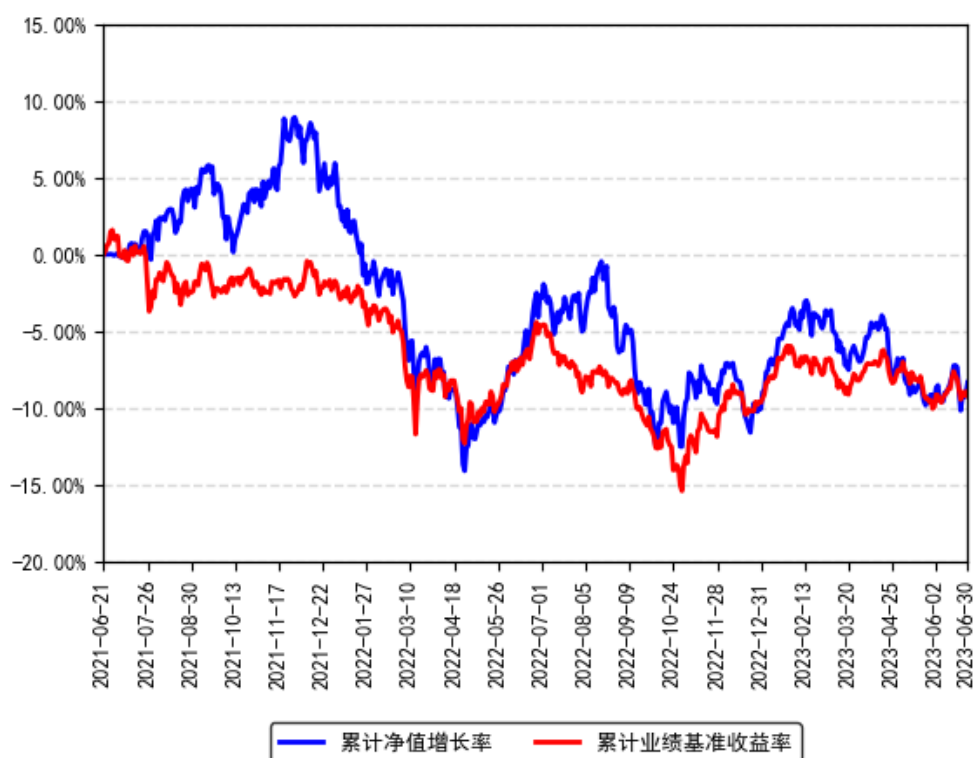
南方价值臻选混合 C

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

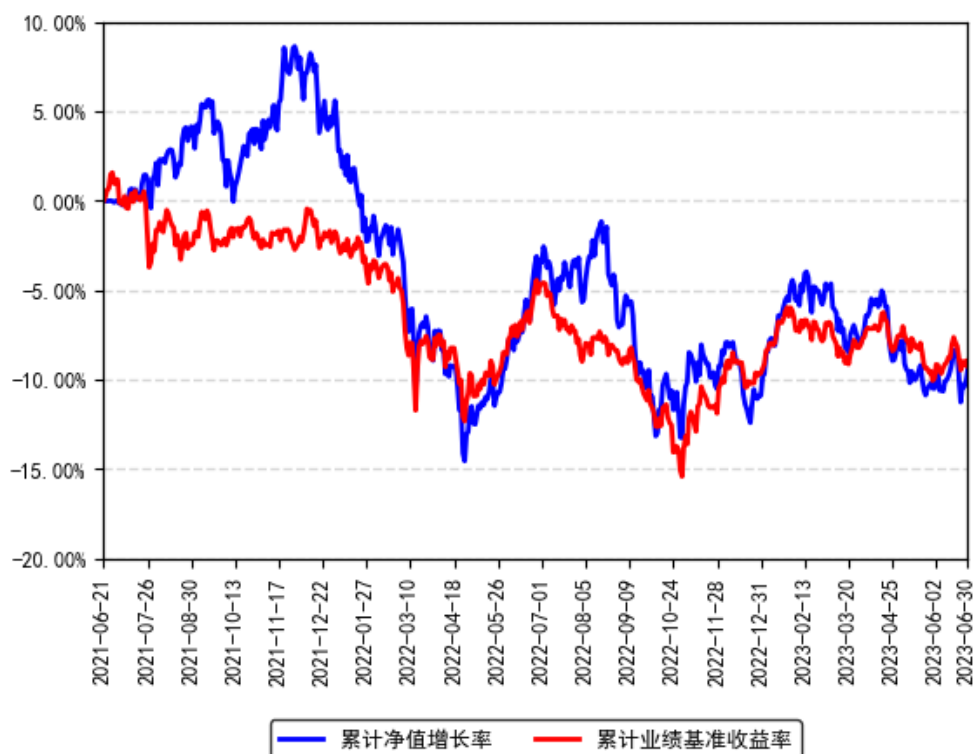
		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	1.15%	0.72%	1.21%	0.44%	-0.06%	0.28%
过去三个月	-2.50%	0.63%	-1.47%	0.41%	-1.03%	0.22%
过去六个月	1.60%	0.64%	0.76%	0.42%	0.84%	0.22%
过去一年	-6.33%	0.76%	-4.52%	0.51%	-1.81%	0.25%
自基金合同 生效起至今	-9.45%	0.80%	-8.95%	0.57%	-0.50%	0.23%

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

南方价值臻选混合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



南方价值臻选混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金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	证券	说明
----	----	-----------	----	----

		(助理) 期限		从业年限	
		任职日期	离任日期		
卢玉珊	本基金基金经理	2021 年 6 月 21 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 0.9166 元，报告期内，份额净值增长率为 1.91%，同期业绩基准增长率为 0.76%；本基金 C 份额净值为 0.9055 元，报告期内，份额净值增长率为 1.60%，同期业绩基准增长率为 0.76%。

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，本基金托管人在对南方价值臻选混合型证券投资基金的托管过程中，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，南方价值臻选混合型证券投资基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方价值臻选混合型证券投资基金的投资运作、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。

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价值臻选混合型证券投资基金 2022 年度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：南方价值臻选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	82,171,092.29	76,933,956.74
结算备付金		233,443.28	555,114.13
存出保证金		46,522.95	70,732.36
交易性金融资产	6.4.3.2	307,595,452.25	328,360,702.04
其中：股票投资		296,960,699.24	304,573,183.81
基金投资		-	-
债券投资		10,634,753.01	23,787,518.23
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	63,000,000.00	70,000,000.00
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		1.88	329,274.84
应收股利		169,029.13	-
应收申购款		27,649.14	5,230.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		453,243,190.92	476,255,011.08
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		65,876,425.11	70,607,512.07
应付赎回款		542,904.89	463,679.15
应付管理人报酬		477,823.69	525,982.36
应付托管费		79,637.28	87,663.75
应付销售服务费		9,538.45	10,013.11
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8.74	7.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	322,518.29	317,460.74
负债合计		67,308,856.45	72,012,318.56
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	421,312,615.07	449,664,720.98
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	-35,378,280.60	-45,422,028.46
净资产合计		385,934,334.47	404,242,692.52
负债和净资产总计		453,243,190.92	476,255,011.08

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，南方价值臻选混合 A 份额净值 0.9166 元，基金份额总额 399,983,297.84 份；南方价值臻选混合 C 份额净值 0.9055 元，基金份额总额 21,329,317.23 份；总份额合计 421,312,615.07 份。

6.2 利润表

会计主体：南方价值臻选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		11,931,347.60	-42,625,496.65
1.利息收入		155,320.12	729,351.15
其中：存款利息收入	6.4.3.9	130,776.62	217,864.55
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		24,543.50	511,486.60
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-826,146.64	-29,800,452.52
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-4,036,217.95	-32,594,057.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	142,030.70	338,613.06
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	3,068,040.61	2,454,992.38
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	12,582,427.28	-13,620,223.99
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	19,746.84	65,828.71
减：二、营业总支出		3,706,150.41	4,268,000.36
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	3,044,749.88	3,519,311.68
2.托管费	6.4.6.2.2	507,458.34	586,551.99
3.销售服务费	6.4.6.2.3	59,509.81	68,091.19
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		5.48	0.76
8.其他费用	6.4.3.16	94,426.90	94,044.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,225,197.19	-46,893,497.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,225,197.19	-46,893,497.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8,225,197.19	-46,893,497.01

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方价值臻选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）	449,664,720.98	-	-45,422,028.46	404,242,692.52
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）	449,664,720.98	-	-45,422,028.46	404,242,692.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-28,352,105.91	-	10,043,747.86	-18,308,358.05
（一）、综合收益总额	-	-	8,225,197.19	8,225,197.19
（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）	-28,352,105.91	-	1,818,550.67	-26,533,555.24
其中：1.基金申购款	8,804,724.98	-	-580,343.99	8,224,380.99

2.基金赎回款	-37,156,830.89	-	2,398,894.66	-34,757,936.23
(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)	421,312,615.07	-	-35,378,280.60	385,934,334.47
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)	528,725,500.19	-	31,327,136.25	560,052,636.44
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)	528,725,500.19	-	31,327,136.25	560,052,636.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-51,564,073.21	-	-44,485,964.39	-96,050,037.60
(一)、综合收益总额	-	-	-46,893,497.01	-46,893,497.01
(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)	-51,564,073.21	-	2,407,532.62	-49,156,540.59
其中: 1.基金申购款	8,681,213.28	-	-484,025.03	8,197,188.25
2.基金赎回款	-60,245,286.49	-	2,891,557.65	-57,353,728.84
(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)	477,161,426.98	-	-13,158,828.14	464,002,598.84

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	82,171,092.29
等于：本金	82,164,474.01
加：应计利息	6,618.28
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	82,171,092.29

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	313,444,752.80	-	296,960,699.24	-16,484,053.56	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	10,166,730.00	100,599.37	10,634,753.01	367,423.64
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	10,166,730.00	100,599.37	10,634,753.01	367,423.64
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	323,611,482.80	100,599.37	307,595,452.25	-16,116,629.92	

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

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	63,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	63,000,000.00	-

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	3.77
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	238,211.96
其中：交易所市场	238,211.96
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
其他	-
合计	322,518.29

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方价值臻选混合 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	427,947,903.48	427,947,903.48
本期申购	5,411,727.40	5,411,727.40
本期赎回（以“-”号填列）	-33,376,333.04	-33,376,333.04
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	399,983,297.84	399,983,297.84

南方价值臻选混合 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	21,716,817.50	21,716,817.50
本期申购	3,392,997.58	3,392,997.58
本期赎回（以“-”号填列）	-3,780,497.85	-3,780,497.85
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	21,329,317.23	21,329,317.23

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

南方价值臻选混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,763,391.49	-38,294,866.08	-43,058,257.57
本期利润	-4,091,094.55	11,968,243.14	7,877,148.59
本期基金份额交易产生的变动数	487,419.68	1,330,754.57	1,818,174.25
其中：基金申购款	-66,634.26	-253,626.70	-320,260.96
基金赎回款	554,053.94	1,584,381.27	2,138,435.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,367,066.36	-24,995,868.37	-33,362,934.73

南方价值臻选混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-428,403.16	-1,935,367.73	-2,363,770.89
本期利润	-266,135.54	614,184.14	348,048.60
本期基金份额交易产生的变动数	8,634.52	-8,258.10	376.42
其中：基金申购款	-84,746.98	-175,336.05	-260,083.03
基金赎回款	93,381.50	167,077.95	260,459.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-685,904.18	-1,329,441.69	-2,015,345.87

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	126,071.58
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	4,215.11
其他	489.93
合计	130,776.62

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	230,089,934.99
减：卖出股票成本总额	233,440,121.25
减：交易费用	686,031.69
买卖股票差价收入	-4,036,217.95

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	194,847.92
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-52,817.22
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	142,030.70

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	22,333,488.53
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	21,860,022.70
减：应计利息总额	526,277.42
减：交易费用	5.63
买卖债券差价收入	-52,817.22

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	3,068,040.61
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	3,068,040.61

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	12,582,427.28
——股票投资	12,408,833.89

——债券投资	173,593.39
——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	12,582,427.28

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	19,546.51
基金转换费收入	200.33
合计	19,746.84

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，将不低于赎回费总额的 25% 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，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 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	9,000.00
银行费用	362.00
其他	762.34
合计	94,426.90

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

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。

6.4.5 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、注册登记机构、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
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”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	75,913,844.08	17.44%	211,380.07	0.03%

6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	140,227.73	1.61%	-	-

6.4.6.1.3 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。

6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

华泰证券	69,344.71	17.40%	40,090.55	16.83%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	103.57	0.01%	103.57	0.04%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,044,749.88	3,519,311.68
其中：支付销售机构的客户维护费	1,276,105.11	1,462,776.42

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 1.50% 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。

6.4.6.2.2 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	507,458.34	586,551.99

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 0.25% 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。

6.4.6.2.3 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		
	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C	合计
工商银行	-	20,207.62	20,207.62
华泰证券	-	667.68	667.68
南方基金	-	9,749.73	9,749.73

兴业证券	-	77.04	77.04
合计	-	30,702.07	30,702.07
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		
	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C	合计
工商银行	-	24,241.54	24,241.54
华泰证券	-	1,278.76	1,278.76
南方基金	-	12,222.57	12,222.57
兴业证券	-	87.66	87.66
合计	-	37,830.53	37,830.53

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。

6.4.6.3 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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
中国工商银行	82,171,092.29	126,071.58	12,287,698.91	193,224.90

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	688472	阿特斯	网下申购	16,207	179,897.70
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	6,596	137,988.32
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
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	270	27,000.00
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券	301322	绿通科技	网下申购	1,302	170,705.22
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	2,253	72,749.37
兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	网下申购	47,332	269,319.08

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	688046	药康生物	网下申购	12,070	271,937.10
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	3,247	262,357.60
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	3,387	192,652.56
华泰联合	123145	药石转债	配债	489	48,900.00
兴业证券	600030	中信证券	配股	17,460	251,947.80

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

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 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
688502	茂莱光学	2023年2月28日	6个月	新股锁定期	69.72	178.59	1,509	105,207.48	269,492.31	-
688486	龙迅股份	2023年2月10日	6个月	新股锁定期	64.76	105.13	1,887	122,202.12	198,380.31	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	2,498	144,034.68	144,034.68	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股锁定期	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
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	1,391	76,505.00	76,505.00	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定期	19.86	18.06	2,505	49,749.30	45,240.30	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股锁定期	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定期	11.10	17.04	1,621	17,993.10	27,621.84	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股锁定期	5.69	5.41	4,734	26,936.46	25,610.94	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定期	23.60	64.67	392	9,251.20	25,350.64	-
301293	三博脑科	2023	6个月	新股锁	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-

		年 4 月 25 日		定期						
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	76.80	107.9 5	219	16,819.20	23,641.05	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	37.88	29.49	746	28,258.48	21,999.54	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	30.85	23.63	857	26,438.45	20,250.91	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
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	127	19,352.26	17,268.19	-
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	143	19,419.40	17,218.63	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	26.74	40.68	413	11,043.62	16,800.84	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	36.15	38.13	398	14,387.70	15,175.74	-
688352	硕中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	12.10	12.07	1,248	15,100.80	15,063.36	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	75.00	90.76	158	11,850.00	14,340.08	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-

688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定期	14.16	16.21	814	11,526.24	13,194.94	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定期	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股锁定期	43.67	53.05	246	10,742.82	13,050.30	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定期	20.92	19.16	660	13,807.20	12,645.60	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股锁定期	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股锁定期	245.56	122.11	68	16,698.08	8,303.48	-
688507	索辰科技	2023年6月20日	1-6个月(含)	锁定期转增	-	122.11	33	-	4,029.63	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股锁定期	30.26	25.33	485	14,676.10	12,285.05	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股锁定期	26.66	31.50	376	10,024.16	11,844.00	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股锁定期	11.88	21.02	559	6,640.92	11,750.18	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定期	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股锁定期	131.11	53.24	131	17,175.41	6,974.44	-
301322	绿通科技	2023年5月25日	1-6个月(含)	锁定期转增	-	53.24	65	-	3,460.60	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定期	19.99	16.90	611	12,213.89	10,325.90	-
601061	中信金属	2023年3月	6个月	新股锁定期	6.58	7.58	1,320	8,685.60	10,005.60	-

		30 日								
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	25.28	29.87	321	8,114.88	9,588.27	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	125.8 8	86.79	107	13,469.16	9,286.53	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	33.99	29.49	282	9,585.18	8,316.18	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	73.45	46.64	169	12,413.05	7,882.16	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰环保	2023	6 个月	新股锁	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-

		年 3 月 28 日		定期						
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁定期	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁定期	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	11.66	12.26	431	5,025.46	5,284.06	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	10.36	11.84	444	4,599.84	5,256.96	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定期	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期	25.98	24.53	144	3,741.12	3,532.32	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
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	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
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	-

6.4.8.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.8.2 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

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 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中国工商银行，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。

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。

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。

6.4.9.4.1.1 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	82,171,092.29	-	-	-	82,171,092.29
结算备付金	233,443.28	-	-	-	233,443.28
存出保证金	46,522.95	-	-	-	46,522.95
交易性金融资产	8,696,256.38	225,668.58	1,712,828.05	296,960,699.24	307,595,452.25
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	63,000,000.00	-	-	-	63,000,000.00
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	1.88	1.88
应收股利	-	-	-	169,029.13	169,029.13
应收申购款	20,020.00	-	-	7,629.14	27,649.14
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	154,167,334.90	225,668.58	1,712,828.05	297,137,359.39	453,243,190.92
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	-	-	-	65,876,425.11	65,876,425.11
应付赎回款	-	-	-	542,904.89	542,904.89
应付管理人报酬	-	-	-	477,823.69	477,823.69
应付托管费	-	-	-	79,637.28	79,637.28
应付销售服务费	-	-	-	9,538.45	9,538.45
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	8.74	8.74
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	322,518.29	322,518.29
负债总计	-	-	-	67,308,856.45	67,308,856.45
利率敏感度缺口	154,167,334.90	225,668.58	1,712,828.05	229,828,502.94	385,934,334.47
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	76,933,956.74	-	-	-	76,933,956.74
结算备付金	555,114.13	-	-	-	555,114.13
存出保证金	70,732.36	-	-	-	70,732.36

交易性金融资产	22,059,618.25	-	1,727,899.98	304,573,183.81	328,360,702.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	70,000,000.00	-	-	-	70,000,000.00
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	329,274.84	329,274.84
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	90.00	-	-	5,140.97	5,230.97
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	169,619,511.48	-	1,727,899.98	304,907,599.62	476,255,011.08
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	-	-	-	70,607,512.07	70,607,512.07
应付赎回款	-	-	-	463,679.15	463,679.15
应付管理人报酬	-	-	-	525,982.36	525,982.36
应付托管费	-	-	-	87,663.75	87,663.75
应付销售服务费	-	-	-	10,013.11	10,013.11
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7.38	7.38
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	317,460.74	317,460.74
负债总计	-	-	-	72,012,318.5	72,012,318.5

				6	6
利率敏感度缺口	169,619,511.48	-	1,727,899.98	232,895,281.06	404,242,692.52

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	-31,914.96	-40,082.08
2.市场利率平行下降25个基点	32,334.95	40,536.68	

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。

6.4.9.4.2.1 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	-	16,763,410.85	-	-	-	16,763,410.85
资产合计	-	16,763,410.85	-	-	-	16,763,410.85
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	-	16,763,410.85	-	-	-	16,763,410.85

项目	上年度末 2022 年 12 月 31 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	-	17,900,987.90	-	-	-	17,900,987.90
资产合计	-	17,900,987.90	-	-	-	17,900,987.90
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	-	17,900,987.90	-	-	-	17,900,987.90

6.4.9.4.2.2 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%	838,170.54	895,049.40
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-838,170.54	-895,049.40

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。本基金的投资组合比例为：本基金股票（含存托凭证）投资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国债期货、股指期货和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。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	296,960,699.24	76.95	304,573,183.81	75.34
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	296,960,699.24	76.95	304,573,183.81	75.34

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%	12,437,070.52	15,581,427.82
	2. 沪深 300 下降 5%	-12,437,070.52	-15,581,427.82

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	297,283,941.14
第二层次	9,093,743.80
第三层次	1,217,767.31
合计	307,595,452.25

6.4.10.2 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。

6.4.10.3 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。

§ 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	296,960,699.24	65.52
	其中：股票	296,960,699.24	65.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,634,753.01	2.35
	其中：债券	10,634,753.01	2.35
	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	63,000,000.00	13.90
	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	82,404,535.57	18.18
8	其他资产	243,203.10	0.05
9	合计	453,243,190.92	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 7,239,233.00 元，占基金资产净值比例 1.88%；通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 9,524,177.85 元，占基金资产净值比例 2.47%。

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	333,970.00	0.09
B	采矿业	16,070,209.50	4.16
C	制造业	177,102,341.69	45.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,356,446.47	1.65
E	建筑业	5,697,385.06	1.48
F	批发和零售业	8,024,108.64	2.08
G	交通运输、仓储和邮政业	13,126,156.56	3.40
H	住宿和餐饮业	735,260.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,646,103.76	7.42
J	金融业	10,790,984.33	2.80
K	房地产业	2,700,015.00	0.70
L	租赁和商务服务业	2,765,258.90	0.72
M	科学研究和技术服务业	571,572.39	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	2,654,757.38	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	369,036.00	0.10
Q	卫生和社会工作	1,031,657.71	0.27
R	文化、体育和娱乐业	2,880,985.00	0.75
S	综合	341,040.00	0.09
	合计	280,197,288.39	72.60

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	1,618,167.10	0.42
材料	1,451,436.24	0.38
工业	700,926.07	0.18
非必需消费	1,601,138.13	0.41
必需消费品	-	-
医疗保健	2,653,910.21	0.69
金融	1,301,697.46	0.34
科技	2,906,016.42	0.75
通讯	4,530,119.22	1.17
公用事业	-	-
房地产	-	-
政府	-	-
合计	16,763,410.85	4.34

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	600519	贵州茅台	6,900	11,667,900.00	3.02
2	601857	中国石油	526,500	3,932,955.00	1.02
3	00857	中国石油股份	158,000	789,546.79	0.20
4	000100	TCL 科技	1,134,424	4,469,630.56	1.16
5	300750	宁德时代	18,360	4,200,584.40	1.09
6	600028	中国石化	518,400	3,297,024.00	0.85
7	00386	中国石油化工股份	86,000	363,942.39	0.09
8	600030	中信证券	177,460	3,510,158.80	0.91
9	600012	皖通高速	278,300	2,916,584.00	0.76
10	00700	腾讯控股	9,200	2,812,702.83	0.73
11	002318	久立特材	163,500	2,784,405.00	0.72
12	000333	美的集团	45,600	2,686,752.00	0.70
13	00763	中兴通讯	53,000	1,534,359.12	0.40
14	000063	中兴通讯	25,000	1,138,500.00	0.29
15	603871	嘉友国际	150,836	2,369,633.56	0.61
16	600323	瀚蓝环境	120,000	2,271,600.00	0.59
17	603833	欧派家居	21,600	2,069,280.00	0.54
18	002568	百润股份	56,900	2,068,315.00	0.54
19	600963	岳阳林纸	277,600	2,045,912.00	0.53
20	000975	银泰黄金	174,200	2,038,140.00	0.53
21	00981	中芯国际	64,500	1,213,141.28	0.31
22	688981	中芯国际	14,448	729,912.96	0.19
23	603129	春风动力	11,900	1,926,610.00	0.50
24	601966	玲珑轮胎	84,100	1,868,702.00	0.48
25	000708	中信特钢	117,700	1,864,368.00	0.48
26	600346	恒力石化	129,800	1,860,034.00	0.48
27	600004	白云机场	129,500	1,857,030.00	0.48
28	600079	人福医药	65,600	1,767,264.00	0.46
29	601899	紫金矿业	155,200	1,764,624.00	0.46
30	002142	宁波银行	68,410	1,730,773.00	0.45
31	000338	潍柴动力	137,900	1,718,234.00	0.45
32	002126	银轮股份	96,300	1,704,510.00	0.44
33	600150	中国船舶	51,600	1,698,156.00	0.44
34	600859	王府井	83,000	1,642,570.00	0.43
35	600886	国投电力	127,300	1,610,345.00	0.42

36	601985	中国核电	227,900	1,606,695.00	0.42
37	688687	凯因科技	53,442	1,576,539.00	0.41
38	688333	铂力特	14,823	1,567,384.02	0.41
39	002517	恺英网络	98,800	1,555,112.00	0.40
40	002415	海康威视	46,700	1,546,237.00	0.40
41	000776	广发证券	104,343	1,534,885.53	0.40
42	600970	中材国际	120,000	1,530,000.00	0.40
43	688777	中控技术	24,330	1,527,437.40	0.40
44	002555	三七互娱	43,500	1,517,280.00	0.39
45	000651	格力电器	40,800	1,489,608.00	0.39
46	002129	TCL 中环	44,500	1,477,400.00	0.38
47	300408	三环集团	49,314	1,447,365.90	0.38
48	600029	南方航空	122,400	738,072.00	0.19
49	01055	中国南方航空股份	172,000	700,926.07	0.18
50	600048	保利发展	109,500	1,426,785.00	0.37
51	601668	中国建筑	247,500	1,420,650.00	0.37
52	603368	柳药集团	57,200	1,413,412.00	0.37
53	600993	马应龙	50,700	1,409,967.00	0.37
54	600872	中炬高新	38,200	1,405,378.00	0.36
55	600176	中国巨石	99,043	1,402,448.88	0.36
56	002138	顺络电子	55,500	1,327,005.00	0.34
57	688125	安达智能	24,131	1,311,519.85	0.34
58	688012	中微公司	8,375	1,310,268.75	0.34
59	00267	中信股份	151,000	1,301,697.46	0.34
60	600685	中船防务	43,400	1,299,830.00	0.34
61	603067	振华股份	105,552	1,282,456.80	0.33
62	603279	景津装备	40,800	1,279,488.00	0.33
63	600285	羚锐制药	79,400	1,275,164.00	0.33
64	001914	招商积余	84,600	1,273,230.00	0.33
65	600298	安琪酵母	33,900	1,227,519.00	0.32
66	600398	海澜之家	177,800	1,223,264.00	0.32
67	601618	中国中冶	307,700	1,221,569.00	0.32
68	300470	中密控股	26,300	1,215,586.00	0.31
69	600845	宝信软件	23,900	1,214,359.00	0.31
70	600309	万华化学	13,800	1,212,192.00	0.31
71	600566	济川药业	41,700	1,210,968.00	0.31
72	002444	巨星科技	55,100	1,205,588.00	0.31
73	600085	同仁堂	20,900	1,203,004.00	0.31
74	002929	润建股份	27,700	1,202,457.00	0.31
75	002602	世纪华通	157,900	1,198,461.00	0.31
76	600741	华域汽车	64,900	1,198,054.00	0.31
77	688050	爱博医疗	5,816	1,194,199.28	0.31

78	300792	壹网壹创	42,700	1,177,239.00	0.31
79	002493	荣盛石化	100,350	1,168,074.00	0.30
80	688080	映翰通	23,874	1,167,438.60	0.30
81	688232	新点软件	21,677	1,166,439.37	0.30
82	002773	康弘药业	59,800	1,143,376.00	0.30
83	002531	天顺风能	74,500	1,134,635.00	0.29
84	002859	洁美科技	40,800	1,130,160.00	0.29
85	600009	上海机场	24,700	1,121,874.00	0.29
86	601088	中国神华	36,400	1,119,300.00	0.29
87	002028	思源电气	23,600	1,102,592.00	0.29
88	002401	中远海科	41,800	1,100,176.00	0.29
89	002603	以岭药业	42,300	1,086,687.00	0.28
90	601728	中国电信	191,200	1,076,456.00	0.28
91	688078	龙软科技	20,871	1,075,900.05	0.28
92	601601	中国太保	41,100	1,067,778.00	0.28
93	605090	九丰能源	47,500	1,060,675.00	0.27
94	002368	太极股份	25,600	1,053,952.00	0.27
95	603738	泰晶科技	63,140	1,048,755.40	0.27
96	300026	红日药业	191,800	1,039,556.00	0.27
97	300628	亿联网络	29,600	1,038,072.00	0.27
98	002092	中泰化学	158,000	1,019,100.00	0.26
99	002352	顺丰控股	22,100	996,489.00	0.26
100	000951	中国重汽	59,000	994,150.00	0.26
101	002027	分众传媒	145,300	989,493.00	0.26
102	600332	白云山	30,900	985,092.00	0.26
103	601607	上海医药	43,900	983,799.00	0.25
104	688786	悦安新材	21,182	982,632.98	0.25
105	002439	启明星辰	32,900	979,104.00	0.25
106	688677	海泰新光	17,241	978,254.34	0.25
107	688618	三旺通信	14,414	976,116.08	0.25
108	688772	珠海冠宇	48,412	975,501.80	0.25
109	300747	锐科激光	31,710	966,520.80	0.25
110	01024	快手-W	19,400	957,817.36	0.25
111	603345	安井食品	6,500	954,200.00	0.25
112	603690	至纯科技	27,360	953,222.40	0.25
113	688037	芯源微	5,547	948,259.65	0.25
114	688111	金山办公	2,006	947,273.32	0.25
115	603236	移远通信	16,190	934,324.90	0.24
116	002262	恩华药业	30,300	934,149.00	0.24
117	688008	澜起科技	15,891	912,461.22	0.24
118	003011	海象新材	28,200	909,450.00	0.24
119	003031	中瓷电子	6,800	905,216.00	0.23
120	300860	锋尚文化	16,200	898,128.00	0.23

121	06078	海吉亚医疗	22,600	883,478.12	0.23
122	300772	运达股份	68,224	878,725.12	0.23
123	601138	工业富联	34,800	876,960.00	0.23
124	300308	中际旭创	5,900	869,955.00	0.23
125	000690	宝新能源	123,700	868,374.00	0.23
126	002595	豪迈科技	24,600	864,198.00	0.22
127	301367	怡和嘉业	5,819	863,190.46	0.22
128	03323	中国建材	194,000	862,125.06	0.22
129	300054	鼎龙股份	34,600	855,658.00	0.22
130	002815	崇达技术	68,000	846,600.00	0.22
131	603324	盛剑环境	22,400	844,480.00	0.22
132	300130	新国都	29,800	844,234.00	0.22
133	000997	新大陆	44,100	833,490.00	0.22
134	300138	晨光生物	46,200	826,980.00	0.21
135	601800	中国交建	75,600	824,796.00	0.21
136	300627	华测导航	25,300	821,491.00	0.21
137	600256	广汇能源	119,500	819,770.00	0.21
138	000568	泸州老窖	3,900	817,323.00	0.21
139	002327	富安娜	96,100	809,162.00	0.21
140	603039	泛微网络	9,800	799,974.00	0.21
141	000516	国际医学	94,600	795,586.00	0.21
142	000922	佳电股份	60,000	789,600.00	0.20
143	601225	陕西煤业	43,300	787,627.00	0.20
144	688041	海光信息	11,510	785,787.70	0.20
145	603087	甘李药业	20,300	781,550.00	0.20
146	688208	道通科技	25,686	778,542.66	0.20
147	688668	鼎通科技	7,903	772,913.40	0.20
148	301391	卡莱特	6,588	771,915.96	0.20
149	002841	视源股份	11,400	761,976.00	0.20
150	688016	心脉医疗	4,218	758,733.84	0.20
151	300556	丝路视觉	30,900	758,286.00	0.20
152	002756	永兴材料	12,090	756,954.90	0.20
153	600600	青岛啤酒	7,300	756,499.00	0.20
154	688036	传音控股	5,132	754,404.00	0.20
155	600105	永鼎股份	100,900	751,705.00	0.19
156	300969	恒帅股份	8,400	740,460.00	0.19
157	600258	首旅酒店	38,800	735,260.00	0.19
158	300252	金信诺	64,600	726,104.00	0.19
159	688021	奥福环保	27,929	723,919.68	0.19
160	002803	吉宏股份	34,900	714,054.00	0.19
161	00425	敏实集团	36,000	713,612.52	0.18
162	300481	濮阳惠成	34,500	709,320.00	0.18
163	002311	海大集团	15,100	707,284.00	0.18

164	600612	老凤祥	10,100	705,788.00	0.18
165	301419	阿莱德	15,200	699,656.00	0.18
166	00941	中国移动	6,000	354,316.91	0.09
167	600941	中国移动	3,700	345,210.00	0.09
168	300351	永贵电器	42,400	696,632.00	0.18
169	600803	新奥股份	36,700	696,566.00	0.18
170	601528	瑞丰银行	143,520	696,072.00	0.18
171	601390	中国中铁	91,700	695,086.00	0.18
172	300687	赛意信息	24,900	691,722.00	0.18
173	601825	沪农商行	126,800	691,060.00	0.18
174	002738	中矿资源	13,500	687,690.00	0.18
175	600056	中国医药	52,900	686,642.00	0.18
176	600460	士兰微	22,600	684,102.00	0.18
177	601111	中国国航	82,800	682,272.00	0.18
178	002532	天山铝业	112,800	675,672.00	0.18
179	300058	蓝色光标	69,700	673,999.00	0.17
180	600026	中远海能	53,100	671,184.00	0.17
181	603878	武进不锈	79,300	670,085.00	0.17
182	300845	捷安高科	30,100	654,073.00	0.17
183	002864	盘龙药业	15,500	653,635.00	0.17
184	002049	紫光国微	7,000	652,750.00	0.17
185	000811	冰轮环境	39,400	620,944.00	0.16
186	000848	承德露露	70,100	620,385.00	0.16
187	688789	宏华数科	7,017	619,811.61	0.16
188	000963	华东医药	14,200	615,854.00	0.16
189	688120	华海清科	2,426	611,473.30	0.16
190	600998	九州通	58,557	607,821.66	0.16
191	603338	浙江鼎力	10,600	593,706.00	0.15
192	688696	极米科技	4,229	589,480.31	0.15
193	01378	中国宏桥	100,500	589,311.18	0.15
194	605377	华旺科技	32,300	583,015.00	0.15
195	603195	公牛集团	6,068	582,892.08	0.15
196	600790	轻纺城	130,700	565,931.00	0.15
197	000938	紫光股份	17,500	557,375.00	0.14
198	601702	华峰铝业	40,500	554,040.00	0.14
199	688003	天准科技	12,363	551,760.69	0.14
200	600511	国药股份	14,200	551,670.00	0.14
201	600276	恒瑞医药	11,500	550,850.00	0.14
202	600528	中铁工业	55,600	549,328.00	0.14
203	688211	中科微至	12,012	542,582.04	0.14
204	605168	三人行	6,235	535,835.90	0.14
205	600125	铁龙物流	88,400	533,936.00	0.14
206	00839	中教控股	94,000	528,663.33	0.14

207	601877	正泰电器	19,000	525,350.00	0.14
208	300592	华凯易佰	19,300	525,346.00	0.14
209	300132	青松股份	90,300	512,001.00	0.13
210	600188	兖矿能源	17,100	511,632.00	0.13
211	603228	景旺电子	19,845	509,024.25	0.13
212	688378	奥来德	10,268	507,239.20	0.13
213	600348	华阳股份	64,050	506,635.50	0.13
214	688569	铁科轨道	11,967	503,451.69	0.13
215	300036	超图软件	21,100	500,281.00	0.13
216	600547	山东黄金	21,100	495,428.00	0.13
217	601058	赛轮轮胎	43,200	492,048.00	0.13
218	300567	精测电子	5,100	485,265.00	0.13
219	600587	新华医疗	13,600	480,488.00	0.12
220	600267	海正药业	42,200	480,236.00	0.12
221	000883	湖北能源	104,900	478,344.00	0.12
222	300253	卫宁健康	44,200	478,244.00	0.12
223	000623	吉林敖东	29,700	476,388.00	0.12
224	601098	中南传媒	40,900	474,440.00	0.12
225	603866	桃李面包	46,800	473,616.00	0.12
226	601000	唐山港	133,700	471,961.00	0.12
227	603283	赛腾股份	10,600	471,700.00	0.12
228	300168	万达信息	41,100	465,663.00	0.12
229	00883	中国海洋石油	45,000	464,677.92	0.12
230	600985	淮北矿业	40,200	463,104.00	0.12
231	300251	光线传媒	56,800	459,512.00	0.12
232	000513	丽珠集团	11,800	459,138.00	0.12
233	603699	纽威股份	30,300	450,864.00	0.12
234	300573	兴齐眼药	2,100	448,980.00	0.12
235	300633	开立医疗	8,200	446,900.00	0.12
236	002984	森麒麟	13,900	437,294.00	0.11
237	600584	长电科技	14,000	436,380.00	0.11
238	002463	沪电股份	20,500	429,270.00	0.11
239	603606	东方电缆	8,700	426,561.00	0.11
240	688372	伟测科技	2,758	422,387.70	0.11
241	01548	金斯瑞生物科技	26,000	421,898.05	0.11
242	002080	中材科技	20,300	416,556.00	0.11
243	300182	捷成股份	65,700	414,567.00	0.11
244	601689	拓普集团	5,100	411,570.00	0.11
245	000860	顺鑫农业	12,200	411,018.00	0.11
246	688279	峰昭科技	3,110	410,520.00	0.11
247	002131	利欧股份	178,400	410,320.00	0.11

248	002381	双箭股份	53,100	409,932.00	0.11
249	300534	陇神戎发	40,100	405,812.00	0.11
250	300260	新莱应材	10,260	405,475.20	0.11
251	301269	华大九天	3,300	405,372.00	0.11
252	688392	骄成超声	3,651	405,224.49	0.10
253	002384	东山精密	15,500	401,450.00	0.10
254	601717	郑煤机	31,600	393,420.00	0.10
255	000676	智度股份	55,600	389,756.00	0.10
256	300003	乐普医疗	17,200	388,892.00	0.10
257	000950	重药控股	57,600	387,648.00	0.10
258	001270	铖昌科技	4,400	384,120.00	0.10
259	603986	兆易创新	3,600	382,500.00	0.10
260	002185	华天科技	41,500	381,800.00	0.10
261	601555	东吴证券	54,900	381,006.00	0.10
262	603596	伯特利	4,800	380,448.00	0.10
263	002946	新乳业	26,500	380,275.00	0.10
264	600977	中国电影	26,600	373,730.00	0.10
265	603379	三美股份	15,700	369,107.00	0.10
266	603377	东方时尚	45,900	369,036.00	0.10
267	300232	洲明科技	40,300	368,342.00	0.10
268	688456	有研粉材	10,920	365,492.40	0.09
269	002987	京北方	16,600	363,872.00	0.09
270	603960	克来机电	19,500	363,675.00	0.09
271	02269	药明生物	10,500	363,513.66	0.09
272	000403	派林生物	18,200	363,272.00	0.09
273	688426	康为世纪	12,011	362,732.20	0.09
274	02096	先声药业	50,000	357,728.24	0.09
275	300873	海晨股份	17,900	356,031.00	0.09
276	600428	中远海特	56,400	355,320.00	0.09
277	600153	建发股份	32,500	354,575.00	0.09
278	02500	启明医疗-B	62,500	354,386.06	0.09
279	688639	华恒生物	3,914	354,138.72	0.09
280	00762	中国联通	74,000	353,413.37	0.09
281	603019	中科曙光	6,900	351,210.00	0.09
282	002011	盾安环境	25,100	347,133.00	0.09
283	01765	希望教育	724,000	347,107.03	0.09
284	301308	江波龙	3,400	345,984.00	0.09
285	002612	朗姿股份	14,500	344,810.00	0.09
286	688266	泽璟制药	7,352	342,235.60	0.09
287	300837	浙矿股份	8,900	341,760.00	0.09
288	600603	广汇物流	49,000	341,040.00	0.09
289	688052	纳芯微	2,150	340,495.50	0.09
290	688622	禾信仪器	9,534	338,457.00	0.09

291	300348	长亮科技	32,400	338,256.00	0.09
292	605358	立昂微	9,176	337,034.48	0.09
293	603378	亚士创能	36,800	335,248.00	0.09
294	300498	温氏股份	18,200	333,970.00	0.09
295	000983	山西焦煤	36,700	333,970.00	0.09
296	300682	朗新科技	14,300	332,904.00	0.09
297	002292	奥飞娱乐	32,800	327,344.00	0.08
298	688121	卓然股份	8,722	326,202.80	0.08
299	300613	富瀚微	5,700	323,418.00	0.08
300	688200	华峰测控	2,106	322,218.00	0.08
301	603093	南华期货	28,800	313,632.00	0.08
302	300031	宝通科技	12,500	309,000.00	0.08
303	002100	天康生物	37,400	308,550.00	0.08
304	002839	张家港行	71,400	302,022.00	0.08
305	301299	卓创资讯	5,200	296,712.00	0.08
306	300571	平治信息	8,400	293,664.00	0.08
307	002385	大北农	44,300	292,380.00	0.08
308	605286	同力日升	10,100	292,092.00	0.08
309	603909	建发合诚	21,060	280,729.80	0.07
310	01801	信达生物	10,000	272,906.08	0.07
311	688502	茂莱光学	1,509	269,492.31	0.07
312	000733	振华科技	2,800	268,380.00	0.07
313	600984	建设机械	58,370	263,832.40	0.07
314	603096	新经典	12,800	260,608.00	0.07
315	833533	骏创科技	17,706	259,747.02	0.07
316	002645	华宏科技	20,800	255,008.00	0.07
317	301289	国缆检测	7,280	254,800.00	0.07
318	301325	曼恩斯特	2,181	248,290.05	0.06
319	601636	旗滨集团	28,400	244,808.00	0.06
320	603915	国茂股份	11,300	239,334.00	0.06
321	688443	智翔金泰	7,452	229,282.00	0.06
322	688439	振华风光	2,065	226,778.30	0.06
323	688630	芯碁微装	2,691	226,097.82	0.06
324	600976	健民集团	2,900	223,561.00	0.06
325	688233	神工股份	7,067	223,175.86	0.06
326	688466	金科环境	10,958	218,721.68	0.06
327	688682	霍莱沃	2,600	217,724.00	0.06
328	688377	迪威尔	8,555	214,302.75	0.06
329	605111	新洁能	4,900	213,248.00	0.06
330	301267	华夏眼科	3,483	212,288.85	0.06
331	002222	福晶科技	7,500	208,050.00	0.05
332	300776	帝尔激光	3,200	207,680.00	0.05
333	600050	中国联通	43,200	207,360.00	0.05

334	601628	中国人寿	5,900	206,264.00	0.05
335	688308	欧科亿	5,040	201,600.00	0.05
336	688486	龙迅股份	1,887	198,380.31	0.05
337	002948	青岛银行	62,100	194,373.00	0.05
338	688099	晶晨股份	2,285	192,671.20	0.05
339	688271	联影医疗	1,362	187,969.62	0.05
340	300996	普联软件	6,020	184,814.00	0.05
341	000661	长春高新	1,300	177,190.00	0.05
342	300763	锦浪科技	1,700	176,970.00	0.05
343	688475	萤石网络	3,840	164,582.40	0.04
344	600958	东方证券	16,800	162,960.00	0.04
345	02382	舜宇光学科 技	2,200	158,516.02	0.04
346	603208	江山欧派	4,160	151,507.20	0.04
347	002068	黑猫股份	12,700	150,749.00	0.04
348	301280	珠城科技	4,174	149,262.24	0.04
349	301486	致尚科技	2,498	144,034.68	0.04
350	688400	凌云光	4,667	142,250.16	0.04
351	301063	海锅股份	5,000	139,300.00	0.04
352	603171	税友股份	3,300	131,934.00	0.03
353	601882	海天精工	3,700	123,210.00	0.03
354	688361	中科飞测	1,568	122,970.40	0.03
355	600037	歌华有线	13,300	110,523.00	0.03
356	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.03
357	688631	莱斯信息	3,202	103,393.63	0.03
358	688156	路德环境	3,550	101,778.50	0.03
359	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.03
360	688623	双元科技	1,066	97,389.86	0.03
361	002558	巨人网络	5,300	95,029.00	0.02
362	688582	芯动联科	2,062	94,056.49	0.02
363	688478	晶升股份	2,007	93,286.29	0.02
364	002242	九阳股份	6,100	91,195.00	0.02
365	603811	诚意药业	7,140	88,750.20	0.02
366	688479	友车科技	2,820	88,187.04	0.02
367	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
368	600419	天润乳业	4,600	74,612.00	0.02
369	688112	鼎阳科技	1,402	73,997.56	0.02
370	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
371	600380	健康元	5,300	67,363.00	0.02
372	688006	杭可科技	2,166	65,998.02	0.02
373	688290	景业智能	960	64,041.60	0.02
374	600059	古越龙山	5,800	60,204.00	0.02
375	002928	华夏航空	6,600	55,770.00	0.01

376	688485	九州一轨	3,580	54,917.20	0.01
377	03690	美团-W	460	51,868.75	0.01
378	688249	晶合集成	2,505	45,240.30	0.01
379	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
380	688472	阿特斯	1,621	27,621.84	0.01
381	688469	中芯集成	4,734	25,610.94	0.01
382	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
383	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
384	301260	格力博	857	20,250.91	0.01
385	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
386	301377	鼎泰高科	770	17,710.00	0.00
387	688531	日联科技	127	17,268.19	0.00
388	688576	西山科技	143	17,218.63	0.00
389	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
390	688146	中船特气	398	15,175.74	0.00
391	688352	硕中科技	1,248	15,063.36	0.00
392	688458	美芯晟	158	14,340.08	0.00
393	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
394	688283	坤恒顺维	200	13,304.00	0.00
395	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
396	688334	西高院	814	13,194.94	0.00
397	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
398	688543	国科军工	246	13,050.30	0.00
399	688512	慧智微	660	12,645.60	0.00
400	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
401	688507	索辰科技	101	12,333.11	0.00
402	688570	天玛智控	485	12,285.05	0.00
403	688433	华曙高科	376	11,844.00	0.00
404	01797	东方甄选	500	11,755.25	0.00
405	001287	中电港	559	11,750.18	0.00
406	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
407	301322	绿通科技	196	10,435.04	0.00
408	301439	泓淋电力	611	10,325.90	0.00
409	601061	中信金属	1,320	10,005.60	0.00
410	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
411	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
412	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
413	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
414	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
415	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
416	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
417	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
418	301345	涛涛车业	169	7,882.16	0.00

419	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00
420	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
421	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
422	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
423	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
424	601133	柏诚股份	431	5,284.06	0.00
425	601065	江盐集团	444	5,256.96	0.00
426	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
427	603125	常青科技	144	3,532.32	0.00
428	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
429	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
430	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
431	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	600012	皖通高速	4,335,011.00	1.07
2	002568	百润股份	3,254,290.00	0.81
3	601857	中国石油	2,850,362.00	0.71
4	600398	海澜之家	2,394,526.00	0.59
5	600079	人福医药	2,132,537.18	0.53
6	600827	百联股份	2,087,765.00	0.52
7	000333	美的集团	2,073,959.00	0.51
8	300792	壹网壹创	2,041,273.00	0.50
9	600963	岳阳林纸	1,996,633.00	0.49
10	601607	上海医药	1,992,394.03	0.49
11	002517	恺英网络	1,747,280.00	0.43
12	000338	潍柴动力	1,712,565.00	0.42
13	600380	健康元	1,647,188.00	0.41
14	00857	中国石油股份	1,607,100.03	0.40
15	601601	中国太保	1,601,536.00	0.40
16	688687	凯因科技	1,597,391.69	0.40
17	002292	奥飞娱乐	1,592,216.00	0.39
18	688668	鼎通科技	1,554,714.57	0.38
19	300130	新国都	1,548,079.00	0.38
20	00700	腾讯控股	1,505,289.07	0.37

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	603681	永冠新材	3,409,458.00	0.84
2	600057	厦门象屿	2,742,934.00	0.68
3	600827	百联股份	2,624,243.00	0.65
4	600487	亨通光电	2,381,102.00	0.59
5	300870	欧陆通	2,297,304.64	0.57
6	688039	当虹科技	2,238,406.90	0.55
7	603063	禾望电气	2,188,462.00	0.54
8	600012	皖通高速	2,027,367.00	0.50
9	300122	智飞生物	1,946,225.00	0.48
10	601878	浙商证券	1,849,701.00	0.46
11	06606	诺辉健康-B	1,813,990.94	0.45
12	600079	人福医药	1,812,603.00	0.45
13	002292	奥飞娱乐	1,748,895.00	0.43
14	300623	捷捷微电	1,730,380.00	0.43
15	603859	能科科技	1,725,516.00	0.43
16	002531	天顺风能	1,617,993.00	0.40
17	002372	伟星新材	1,581,697.00	0.39
18	603693	江苏新能	1,578,620.50	0.39
19	300653	正海生物	1,567,619.00	0.39
20	300179	四方达	1,529,827.00	0.38

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	213,418,802.79
卖出股票收入（成交）总额	230,089,934.99

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	8,696,256.38	2.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

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）	1,938,496.63	0.50
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,634,753.01	2.76

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	019688	22 国债 23	86,000	8,696,256.38	2.25
2	113653	永 22 转债	4,550	495,159.80	0.13
3	110091	合力转债	2,150	335,416.49	0.09
4	113062	常银转债	2,370	270,409.14	0.07
5	113060	浙 22 转债	1,150	139,098.14	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

本基金投资的前十名证券的发行主体中,中信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	46,522.95
2	应收清算款	1.88
3	应收股利	169,029.13
4	应收利息	-
5	应收申购款	27,649.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	243,203.10

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	113653	永 22 转债	495,159.80	0.13
2	110091	合力转债	335,416.49	0.09
3	113062	常银转债	270,409.14	0.07
4	113060	浙 22 转债	139,098.14	0.04
5	113655	欧 22 转债	86,049.86	0.02
6	113661	福 22 转债	75,049.06	0.02
7	118024	冠宇转债	74,651.46	0.02
8	111010	立昂转债	57,385.26	0.01
9	123145	药石转债	56,591.43	0.01
10	111007	永和转债	56,394.63	0.01
11	118013	道通转债	55,182.77	0.01
12	113059	福莱转债	29,979.01	0.01
13	127077	华宏转债	22,153.37	0.01
14	118027	宏图转债	18,776.59	0.00
15	118019	金盘转债	15,327.52	0.00
16	118026	利元转债	10,302.96	0.00

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
南方价值臻选混合 A	4,761	84,012.45	693,127.15	0.17%	399,290,170.69	99.83%
南方价值臻选混合 C	951	22,428.30	-	-	21,329,317.23	100.00%
合计	5,712	73,759.21	693,127.15	0.16%	420,619,487.92	99.84%

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	南方价值臻选混合 A	567,613.26	0.1419%
	南方价值臻选混合 C	5,010.93	0.0235%
	合计	572,624.19	0.1359%

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	南方价值臻选混合 A	0
	南方价值臻选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方价值臻选混合 A	0~10
	南方价值臻选混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C
基金合同生效日(2021年6月21日)基金份额总额	1,409,686,126.75	44,583,592.72
本报告期期初基金份额总额	427,947,903.48	21,716,817.50
本报告期基金总申购份额	5,411,727.40	3,392,997.58
减：报告期基金总赎回份额	33,376,333.04	3,780,497.85
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	399,983,297.84	21,329,317.23

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	1	96,736,950.20	22.22%	88,780.28	22.28%	-
华泰证券	3	75,913,844.08	17.44%	69,344.71	17.40%	-
申万宏源	2	72,146,711.21	16.58%	66,361.00	16.65%	-
金元证券	1	55,897,526.44	12.84%	51,400.70	12.90%	-
国联证券	1	39,902,117.65	9.17%	36,317.32	9.11%	-
中金公司	1	35,245,153.89	8.10%	31,910.16	8.01%	-
上海证券	1	28,872,938.71	6.63%	26,298.82	6.60%	-
中泰证券	1	13,257,615.31	3.05%	12,214.48	3.06%	-
西南证券	1	6,661,451.65	1.53%	6,136.06	1.54%	-
国海证券	1	5,375,110.00	1.23%	4,952.20	1.24%	-
光大证券	1	5,260,929.34	1.21%	4,846.96	1.22%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

东北证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
天风证券	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：

华融证券

西南证券

国海证券

上海证券

退租交易单元：

无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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	8,578,930.00	98.39%	125,000,000.00	66.49%	-	-
华泰证券	140,227.73	1.61%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	63,000,000.00	33.51%	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会	2023-02-16

		会基金电子披露网站	
2	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	2023-03-01
3	南方基金关于旗下部分基金增加攀赢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	2023-03-02
4	南方基金关于旗下部分基金增加泰信财富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
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	2023-03-22
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	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
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	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
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	南方基金关于旗下部分基金增加招商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	2023-05-09
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	2023-05-10
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	2023-06-03
12	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	2023-06-15
13	南方基金关于旗下部分基金增加中欧财富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	2023-06-16
14	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价值臻选混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方价值臻选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方价值臻选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、《南方价值臻选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>