

# 南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资 基金 2024 年中期报告

2024 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：南京银行股份有限公司

送出日期：2024 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的法律责任。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。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

## 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	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.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	南方鑫悦 15 个月持有混合	
基金主代码	016553	
交易代码	016553	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 9 月 14 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	南京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	443,751,904.42 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方鑫悦 15 个月持有混合 A	南方鑫悦 15 个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	016553	016554
报告期末下属分级基金的份 额总额	435,119,142.75 份	8,632,761.67 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，投资于精选的股票，通过严谨的风险管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、金融衍生品投资策略；5、资产支持证券投资策略
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+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×30%
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	南京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95302

传真	0755-82763889	025-86776189
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	南京市建邺区江山大街 88 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	南京市建邺区江山大街 88 号
邮政编码	518017	210019
法定代表人	周易	谢宁

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

## 2.5 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、南方鑫悦 15 个月持有混合 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-44,961,064.45
本期利润	18,011,198.58
加权平均基金份额本期利润	0.0304
本期加权平均净值利润率	3.14%
本期基金份额净值增长率	2.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-24,467,978.45
期末可供分配基金份额利润	-0.0562
期末基金资产净值	426,307,301.62
期末基金份额净值	0.9797
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-2.03%

#### 2、南方鑫悦 15 个月持有混合 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,126,998.28
本期利润	263,575.10
加权平均基金份额本期利润	0.0206
本期加权平均净值利润率	2.16%
本期基金份额净值增长率	1.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-573,132.64
期末可供分配基金份额利润	-0.0664
期末基金资产净值	8,367,185.29
期末基金份额净值	0.9692
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-3.08%

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

南方鑫悦 15 个月持有混合 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	-3.02%	0.73%	-1.96%	0.33%	-1.06%	0.40%
过去三个月	0.63%	0.87%	0.39%	0.52%	0.24%	0.35%
过去六个月	2.22%	0.91%	2.48%	0.62%	-0.26%	0.29%
过去一年	-4.83%	0.75%	-4.85%	0.61%	0.02%	0.14%
自基金合同生效起至今	-2.03%	0.64%	-6.62%	0.66%	4.59%	-0.02%

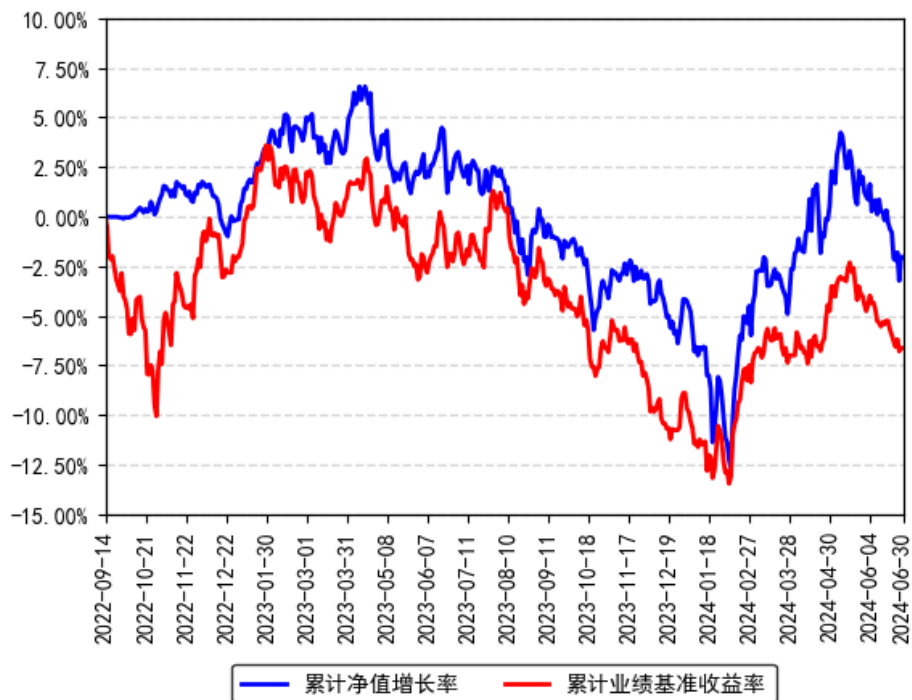
南方鑫悦 15 个月持有混合 C

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	-3.06%	0.73%	-1.96%	0.33%	-1.10%	0.40%

过去三个月	0.48%	0.87%	0.39%	0.52%	0.09%	0.35%
过去六个月	1.92%	0.92%	2.48%	0.62%	-0.56%	0.30%
过去一年	-5.40%	0.75%	-4.85%	0.61%	-0.55%	0.14%
自基金合同生效起至今	-3.08%	0.64%	-6.62%	0.66%	3.54%	-0.02%

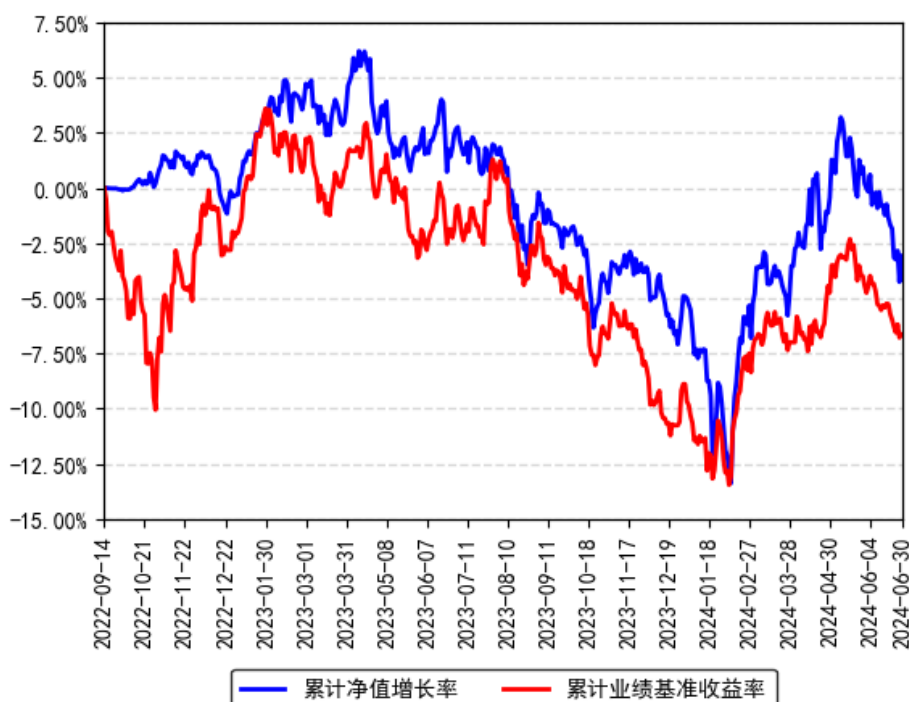
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方鑫悦15个月持有混合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





南方鑫悦15个月持有混合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。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
卢玉珊	本基金	2022年9月	-	15年	女，清华大学会计学硕士，具有基金从

基金经 理	月 14 日			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；2024 年 5 月 24 日至今，兼任投资经理。
----------	--------	--	--	---

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
卢玉珊	公募基金	7	1,970,902,693.12	2015 年 12 月 30 日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	10	10,838,490,115.51	2022 年 12 月 01 日
	合计	17	12,809,392,808.63	-

#### 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 69 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

上半年整体市场维持震荡，一季度大幅波动，在 1 月下跌后强势反弹，二季度在宏观弱复苏背景下震荡下跌。具体来看，沪深 300 上涨 0.89%，上证指数、深证成指和创业板指分别下跌 0.25%、7.10% 和 10.99%，中证 1000 和国证 2000 分别下跌 16.84% 和 19.67%。分行业看，银行、煤炭和公用事业涨幅都在 10% 以上，家用电器、石油石化、通信、交运和有色也是正收益，计算机、商贸零售、社会服务、传媒、地产等行业有 20% 以上的跌幅。整体来看低估值、大盘风格占优，成长、小盘表现较弱。

我们年初的判断的高股息、出口链、上游资源品方向上基本是正确的，但是由于结构上偏均衡和分散，尾部持仓形成了一定的拖累，没有显著跑赢市场。中长期看，经济高质量发展背景下，投资范式向更看重确定性和可持续性等方向的转变很可能是长期趋势，叠加监管政策导向明确，小盘的估值溢价大概率将继续收敛。我们继续减持尾部的中小市值个股，提高组合集中度。

#### 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 0.9797 元，报告期内，份额净值增长率为 2.22%，同期业绩基准增长率为 2.48%；本基金 C 份额净值为 0.9692 元，报告期内，份额净值增长率为 1.92%，同期业绩基准增长率为 2.48%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场整体估值无论是相对自身历史，还是相对债券资产，均处于相对低估状态，以年度为展望，权益类资产仍是性价比较高的选择。对于标的的选择上，我们会更加看重竞争格局的稳定、资产负债表的稳健和自由现金流的健康。

自 2022 年以来，我们可以观察到上市公司的分红比例正在逐步提升，这不仅支撑了股息率，也反映出对股东回报的日益重视。在这种长期投资视角下，投资者的估值体系正在悄然发生变化，逐渐从传统的市盈率（PE）和市净率（PB）转向更加关注股息率以及企业价值与自由现金流的比率（EV/FCF）。

这种转变意味着投资者开始更加注重公司能够提供的实际回报，而不仅仅是依赖市场估值的增长。高分红比例和股息率的提升，为投资者提供了更稳定的现金流入，这对于寻求长期稳定收益的投资者来说尤为重要。同时，EV/FCF 提供了一个更为全面的视角来评估公司的内在价值。它不仅考虑了公司的盈利能力，还考虑了公司的现金流创造能力，这有助于投资者识别那些具有强大自我融资能力、较低财务风险和良好长期增长潜力的企业。

展望后市，我们主要关注以下几条投资主线：一是现金流较好的低估值高股息的个股，包括运营商、能源、水电、高速公路等在内；二是出口链上具有国际竞争力的企业，比如家电、电力设备、纺织制造等；三是供需结构较好的上游资源品；四是美股科技映射。同时我们将增加对底部赔率品种的研究。

#### 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,南京银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《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,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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,本托管人根据《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规定,对本基金的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、利润分配以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在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

本报告期内,由南方基金管理股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、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真实、准确、完整。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体:南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日:2024 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产:			

货币资金	6.4.3.1	15,265,921.49	53,703,392.87
结算备付金		69,576.18	441,742.70
存出保证金		252,404.85	300,290.50
交易性金融资产	6.4.3.2	403,016,006.95	551,382,544.19
其中：股票投资		392,368,518.50	511,353,511.82
基金投资		-	-
债券投资		10,647,488.45	40,029,032.37
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	-	-15,712.08
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		16,710,458.11	142,451,889.38
应收股利		660,226.27	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		435,974,593.85	748,264,147.56
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		315,452.70	3,802,042.38
应付赎回款		242,039.01	14,306,527.34
应付管理人报酬		441,374.46	869,501.03
应付托管费		73,562.39	144,916.87
应付销售服务费		4,239.33	11,218.44
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7.26	11.36
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	223,431.79	363,017.95
负债合计		1,300,106.94	19,497,235.37
净资产：			

实收基金	6.4.3.7	443,751,904.42	760,556,445.33
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	-9,077,417.51	-31,789,533.14
净资产合计		434,674,486.91	728,766,912.19
负债和净资产总计		435,974,593.85	748,264,147.56

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，南方鑫悦 15 个月持有混合 A 份额净值 0.9797 元，基金份额总额 435,119,142.75 份；南方鑫悦 15 个月持有混合 C 份额净值 0.9692 元，基金份额总额 8,632,761.67 份；总份额合计 443,751,904.42 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		22,488,411.91	39,151,445.76
1.利息收入		158,388.57	3,750,675.26
其中：存款利息收入	6.4.3.9	138,537.57	336,569.37
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		19,851.00	3,414,105.89
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-42,032,813.07	29,338,265.77
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-50,459,632.08	21,340,185.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	345,651.23	836,477.76
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	8,081,167.78	7,161,602.44
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	64,362,836.41	6,062,504.73

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	-	-
减：二、营业总支出		4,213,638.23	9,041,850.02
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	3,499,190.85	7,599,528.49
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.6.2.2	583,198.46	1,266,588.09
3.销售服务费	6.4.6.2.3	36,618.17	80,984.50
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		6.01	1.91
8.其他费用	6.4.3.16	94,624.74	94,747.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,274,773.68	30,109,595.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,274,773.68	30,109,595.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		18,274,773.68	30,109,595.74

### 6.3 净资产变动表

会计主体：南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	760,556,445.33	-	-31,789,533.14	728,766,912.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	760,556,445.33	-	-31,789,533.14	728,766,912.19
三、本期增减变动额（减少以	-316,804,540.91	-	22,712,115.63	-294,092,425.28



“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	18,274,773.68	18,274,773.68
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-316,804,540.91	-	4,437,341.95	-312,367,198.96
其中: 1.基金申购款	1,077,071.10	-	-26,840.05	1,050,231.05
2.基金赎回款	-317,881,612.01	-	4,464,182.00	-313,417,430.01
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	443,751,904.42	-	-9,077,417.51	434,674,486.91
项目	上年度可比期间 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	984,059,311.45	-	-1,381,748.67	982,677,562.78
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	984,059,311.45	-	-1,381,748.67	982,677,562.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	5,594,356.01	-	30,336,412.12	35,930,768.13
(一)、综合收益总额	-	-	30,109,595.74	30,109,595.74
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	5,594,356.01	-	226,816.38	5,821,172.39

其中：1.基金申购款	5,594,356.01	-	226,816.38	5,821,172.39
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	989,653,667.46	-	28,954,663.45	1,018,608,330.91

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\_\_\_\_                      \_\_\_\_常克川\_\_\_\_                      \_\_\_\_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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	15,265,921.49

等于：本金	15,263,697.78
加：应计利息	2,223.71
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	15,265,921.49

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	373,612,146.38	-	392,368,518.50	18,756,372.12	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	10,229,216.00	150,577.35	10,647,488.45	267,695.10
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	10,229,216.00	150,577.35	10,647,488.45	267,695.10
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	383,841,362.38	150,577.35	403,016,006.95	19,024,067.22	

#### 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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	138,896.43
其中：交易所市场	138,896.43
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	223,431.79

#### 6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方鑫悦 15 个月持有混合 A		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	741,926,439.32	741,926,439.32
本期申购	1,077,059.67	1,077,059.67
本期赎回（以“-”号填列）	-307,884,356.24	-307,884,356.24
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	435,119,142.75	435,119,142.75

南方鑫悦 15 个月持有混合 C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,630,006.01	18,630,006.01
本期申购	11.43	11.43
本期赎回（以“-”号填列）	-9,997,255.77	-9,997,255.77
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	8,632,761.67	8,632,761.67
-----	--------------	--------------

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

南方鑫悦 15 个月持有混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	931,464.44	-31,807,116.27	-30,875,651.83
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	931,464.44	-31,807,116.27	-30,875,651.83
本期利润	-44,961,064.45	62,972,263.03	18,011,198.58
本期基金份额交易产生的变动数	19,561,621.56	-15,509,009.44	4,052,612.12
其中：基金申购款	-62,628.84	35,789.22	-26,839.62
基金赎回款	19,624,250.40	-15,544,798.66	4,079,451.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-24,467,978.45	15,656,137.32	-8,811,841.13

南方鑫悦 15 个月持有混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-120,281.97	-793,599.34	-913,881.31
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-120,281.97	-793,599.34	-913,881.31
本期利润	-1,126,998.28	1,390,573.38	263,575.10
本期基金份额交易产生的变动数	674,147.61	-289,417.78	384,729.83
其中：基金申购款	-0.86	0.43	-0.43
基金赎回款	674,148.47	-289,418.21	384,730.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-573,132.64	307,556.26	-265,576.38

#### 6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	129,757.14
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	6,379.98
其他	2,400.45

合计	138,537.57
----	------------

#### 6.4.3.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	411,941,858.32
减：卖出股票成本总额	461,823,128.32
减：交易费用	578,362.08
买卖股票差价收入	-50,459,632.08

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	289,732.10
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	55,919.13
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	345,651.23

##### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	29,652,193.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	28,984,148.00
减：应计利息总额	612,097.08
减：交易费用	29.59
买卖债券差价收入	55,919.13

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

##### 6.4.3.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

##### 6.4.3.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,081,167.78
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	8,081,167.78

#### 6.4.3.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	64,362,836.41
——股票投资	64,437,192.30
——债券投资	-74,355.89
——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	64,362,836.41

#### 6.4.3.15 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
其他	1,089.38
合计	94,624.74

#### 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

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

#### 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
南京银行股份有限公司(“南京银行”)	基金托管人、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
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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,499,190.85	7,599,528.49



其中：应支付销售机构的客户维护费	1,571,710.50	3,416,058.12
应支付基金管理人的净管理费	1,927,480.35	4,183,470.37

注：于 2023 年 7 月 10 日前，支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% \div \text{当年天数}。$$

根据《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》，自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% \div \text{当年天数}。$$

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	583,198.46	1,266,588.09

注：于 2023 年 7 月 10 日前，支付基金托管人南京银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}。$$

根据《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》，自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金托管人南京银行的托管费按前一日基金资产净值 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}。$$

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方鑫悦 15 个月持有混合 A	南方鑫悦 15 个月持有混合 C	合计

南方基金	-	0.19	0.19
南京银行	-	36,617.98	36,617.98
合计	-	36,618.17	36,618.17
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	南方鑫悦 15 个月持有混合 A	南方鑫悦 15 个月持有混合 C	合计
南方基金	-	1.03	1.03
南京银行	-	80,983.47	80,983.47
合计	-	80,984.50	80,984.50

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

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
南京银行	15,265,921.49	129,757.14	272,808,930.95	60,034.34

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	688709	成都华微	网下申购	10,448	163,929.12
华泰联合	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
华泰联合	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88
华泰联合	603312	西典新能	网下申购	1,296	37,609.92
兴业证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80

上年度可比期间 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	42,083	467,121.30
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
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	240	24,000.00
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	2,604	341,410.44
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	117,019	665,838.11

#### 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（2024 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
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股锁定期	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-
301589	诺瓦星云	2024年5月30日	1-6个月(含)	锁定期转增	-	188.01	553	-	103,969.53	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定期	86.96	174.93	168	14,609.28	29,388.24	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定期	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定期	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股锁定期	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定期	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024年5月22日	1-6个月(含)	锁定期转增	-	91.24	42	-	3,832.08	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股锁定期	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股锁定期	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
603341	龙旗科技	2024	6个月	新股锁	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-

		年 2 月 23 日		定期						
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股锁 定期	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股锁 定期	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股锁 定期	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-

603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定期	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定期	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股锁定期	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股锁定期	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股锁定期	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024年6月3日	1-6个月(含)	锁定期转增	-	15.25	40	-	610.00	-

#### 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金持有的上述流通受限证券，根据中国证监会、证券交易所发布的相关规定，在受限期内不得转让：

1. 根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2. 基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3. 根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，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。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，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超过基金资产净值的 15%。于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合该要求。

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。

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。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。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	15,265,921.49	-	-	-	15,265,921.49
结算备付金	69,576.18	-	-	-	69,576.18
存出保证金	252,404.85	-	-	-	252,404.85
交易性金融资产	10,264,049.44	302,285.88	81,153.13	392,368,518.50	403,016,006.95
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	-	-	-	16,710,458.11	16,710,458.11
应收股利	-	-	-	660,226.27	660,226.27
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	25,851,951.96	302,285.88	81,153.13	409,739,202.88	435,974,593.85
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	-	-	-	315,452.70	315,452.70
应付赎回款	-	-	-	242,039.01	242,039.01
应付管理人报酬	-	-	-	441,374.46	441,374.46
应付托管费	-	-	-	73,562.39	73,562.39
应付销售服务费	-	-	-	4,239.33	4,239.33
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7.26	7.26
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	223,431.79	223,431.79
负债总计	-	-	-	1,300,106.94	1,300,106.94
利率敏感度缺口	25,851,951.96	302,285.88	81,153.13	408,439,095.94	434,674,486.91
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	53,703,392.87	-	-	-	53,703,392.87

结算备付金	441,742.70	-	-	-	441,742.70
存出保证金	300,290.50	-	-	-	300,290.50
交易性金融资产	38,467,871.25	549,034.09	1,012,127.03	511,353,511.82	551,382,544.19
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-15,712.08	-	-	-	-15,712.08
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	142,451,889.38	142,451,889.38
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	92,897,585.24	549,034.09	1,012,127.03	653,805,401.20	748,264,147.56
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	-	-	-	3,802,042.38	3,802,042.38
应付赎回款	-	-	-	14,306,527.34	14,306,527.34
应付管理人报酬	-	-	-	869,501.03	869,501.03
应付托管费	-	-	-	144,916.87	144,916.87
应付销售服务费	-	-	-	11,218.44	11,218.44
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	11.36	11.36
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税	-	-	-	-	-

负债					
其他负债	-	-	-	363,017.95	363,017.95
负债总计	-	-	-	19,497,235.37	19,497,235.37
利率敏感度缺口	92,897,585.24	549,034.09	1,012,127.03	634,308,165.83	728,766,912.19

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-1,966.79	-2,084.86
2.市场利率平行下降25个基点	1,967.46	2,171.03	

#### 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或负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	-	31,931,079.08	-	-	-	31,931,079.08
资产合计	-	31,931,079.08	-	-	-	31,931,079.08
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	-	31,931,079.08	-	-	-	31,931,079.08

项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日
----	-----------------------

	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	20,933,549.69	-	-	-	20,933,549.69
资产合计	-	20,933,549.69	-	-	-	20,933,549.69
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	-	20,933,549.69	-	-	-	20,933,549.69

#### 6.4.9.4.2 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	1,596,553.95	1,046,677.48
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-1,596,553.95	-1,046,677.48

#### 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 60%–95%（其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%）。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、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，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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	392,368,518.50	90.27	511,353,511.82	70.17
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	392,368,518.50	90.27	511,353,511.82	70.17

#### 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 上升 5%	15,230,535.15	20,589,481.00
	2. 沪深 300 下降 5%	-15,230,535.15	-20,589,481.00

#### 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 2024 年 6 月 30 日
---------------	---------------------

第一层次	392,646,913.44
第二层次	9,897,077.27
第三层次	472,016.24
合计	403,016,006.95

#### 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，确定相关金融工具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

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 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	392,368,518.50	90.00
	其中：股票	392,368,518.50	90.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,647,488.45	2.44
	其中：债券	10,647,488.45	2.44
	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	15,335,497.67	3.52
8	其他各项资产	17,623,089.23	4.04
9	合计	435,974,593.85	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 3,689,202.24 元，占基金资产净值比例 0.85%；通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 28,241,876.84 元，占基金资产净值比例 6.50%。

## 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	1,415,832.00	0.33
B	采矿业	49,647,389.04	11.42
C	制造业	227,321,298.18	52.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,044,432.51	8.98
E	建筑业	1,095,048.00	0.25
F	批发和零售业	4,022,186.04	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	13,079,565.56	3.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,621,480.31	2.21
J	金融业	5,946,120.40	1.37
K	房地产业	867,732.00	0.20
L	租赁和商务服务业	2,516,892.00	0.58
M	科学研究和技术服务业	1,580,569.38	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	3,234,306.00	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,044,588.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	360,437,439.42	82.92

### 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	5,616,742.24	1.29
材料	9,645,624.81	2.22
工业	4,441,027.87	1.02
非必需消费品	1,430,653.28	0.33



必需消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	1,443,668.10	0.33
科技	2,676,415.85	0.62
通讯	4,857,245.54	1.12
公用事业	1,819,701.39	0.42
房地产	-	-
政府	-	-
合计	31,931,079.08	7.35

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

金额单位：人民币元

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	000333	美的集团	158,700	10,236,150.00	2.35
2	601088	中国神华	134,300	5,958,891.00	1.37
3	01088	中国神华	96,500	3,166,246.64	0.73
4	600900	长江电力	269,800	7,802,616.00	1.80
5	600886	国投电力	407,200	7,427,328.00	1.71
6	601225	陕西煤业	273,252	7,041,704.04	1.62
7	601985	中国核电	620,400	6,613,464.00	1.52
8	601567	三星医疗	159,100	5,568,500.00	1.28
9	601857	中国石油	539,200	5,564,544.00	1.28
10	000521	长虹美菱	726,574	5,507,430.92	1.27
11	000338	潍柴动力	323,800	5,258,512.00	1.21
12	600941	中国移动	31,100	3,343,250.00	0.77
13	00941	中国移动	26,000	1,827,185.36	0.42
14	601077	渝农商行	739,000	3,709,780.00	0.85
15	03618	重庆农村商业银行	413,000	1,443,668.10	0.33
16	600690	海尔智家	175,516	4,981,144.08	1.15
17	603871	嘉友国际	277,424	4,907,630.56	1.13
18	00883	中国海洋石油	202,000	4,129,694.46	0.95
19	002126	银轮股份	223,281	3,887,322.21	0.89
20	600482	中国动力	183,200	3,568,736.00	0.82
21	600985	淮北矿业	212,000	3,548,880.00	0.82
22	605090	九丰能源	122,000	3,538,000.00	0.81
23	000425	徐工机械	478,700	3,422,705.00	0.79
24	600188	兖矿能源	98,400	2,236,632.00	0.51
25	01171	兖矿能源	111,800	1,138,739.88	0.26

26	601600	中国铝业	363,700	2,775,031.00	0.64
27	02600	中国铝业	80,000	389,166.75	0.09
28	300979	华利集团	51,900	3,158,115.00	0.73
29	601702	华峰铝业	172,200	3,144,372.00	0.72
30	600685	中船防务	112,100	3,127,590.00	0.72
31	000651	格力电器	76,800	3,012,096.00	0.69
32	600285	羚锐制药	123,000	2,977,830.00	0.69
33	600150	中国船舶	72,900	2,967,759.00	0.68
34	002737	葵花药业	124,800	2,917,824.00	0.67
35	000739	普洛药业	214,800	2,914,836.00	0.67
36	603993	洛阳钼业	334,800	2,845,800.00	0.65
37	000999	华润三九	66,170	2,817,518.60	0.65
38	000975	山金国际	172,300	2,806,767.00	0.65
39	002938	鹏鼎控股	68,100	2,707,656.00	0.62
40	01070	TCL 电子	464,000	2,676,415.85	0.62
41	600873	梅花生物	262,800	2,633,256.00	0.61
42	002318	久立特材	112,300	2,619,959.00	0.60
43	002028	思源电气	38,600	2,582,340.00	0.59
44	601918	新集能源	263,100	2,565,225.00	0.59
45	002532	天山铝业	315,700	2,560,327.00	0.59
46	601966	玲珑轮胎	134,700	2,474,439.00	0.57
47	002327	富安娜	244,900	2,461,245.00	0.57
48	301004	嘉益股份	26,700	2,429,700.00	0.56
49	002039	黔源电力	137,140	2,413,664.00	0.56
50	688188	柏楚电子	12,953	2,390,476.15	0.55
51	600971	恒源煤电	198,400	2,368,896.00	0.54
52	600993	马应龙	88,800	2,368,296.00	0.54
53	689009	九号公司	63,970	2,354,735.70	0.54
54	002884	凌霄泵业	122,000	2,342,400.00	0.54
55	002475	立讯精密	59,400	2,335,014.00	0.54
56	600398	海澜之家	251,400	2,322,936.00	0.53
57	601699	潞安环能	128,000	2,320,640.00	0.53
58	601000	唐山港	488,300	2,295,010.00	0.53
59	603195	公牛集团	29,186	2,250,824.32	0.52
60	600066	宇通客车	86,200	2,223,960.00	0.51
61	600585	海螺水泥	92,900	2,191,511.00	0.50
62	600566	济川药业	68,900	2,184,819.00	0.50
63	600803	新奥股份	104,200	2,167,360.00	0.50
64	688169	石头科技	5,395	2,118,077.00	0.49
65	688036	传音控股	27,539	2,107,835.06	0.48
66	000883	湖北能源	342,800	2,060,228.00	0.47
67	000983	山西焦煤	197,000	2,031,070.00	0.47
68	601058	赛轮轮胎	142,300	1,992,200.00	0.46

69	300408	三环集团	68,100	1,987,839.00	0.46
70	02099	中国黄金国际	43,000	1,966,186.52	0.45
71	000792	盐湖股份	111,800	1,950,910.00	0.45
72	600031	三一重工	117,500	1,938,750.00	0.45
73	002444	巨星科技	78,100	1,929,070.00	0.44
74	600348	华阳股份	192,650	1,918,794.00	0.44
75	000726	鲁泰 A	280,700	1,858,234.00	0.43
76	603277	银都股份	61,100	1,835,444.00	0.42
77	603236	移远通信	38,640	1,805,647.20	0.42
78	000429	粤高速 A	171,900	1,789,479.00	0.41
79	688772	珠海冠宇	118,771	1,769,687.90	0.41
80	000657	中钨高新	189,040	1,727,825.60	0.40
81	300054	鼎龙股份	74,800	1,696,464.00	0.39
82	000598	兴蓉环境	224,500	1,688,240.00	0.39
83	688187	时代电气	33,982	1,678,031.16	0.39
84	601528	瑞丰银行	350,220	1,653,038.40	0.38
85	000811	冰轮环境	169,800	1,638,570.00	0.38
86	002027	分众传媒	269,500	1,633,170.00	0.38
87	01258	中国有色矿业	258,000	1,603,560.51	0.37
88	000408	藏格矿业	66,200	1,593,434.00	0.37
89	688677	海泰新光	39,957	1,567,513.11	0.36
90	000690	宝新能源	305,200	1,556,520.00	0.36
91	002078	太阳纸业	111,400	1,554,030.00	0.36
92	000589	贵州轮胎	306,200	1,552,434.00	0.36
93	601882	海天精工	67,700	1,551,007.00	0.36
94	603338	浙江鼎力	25,500	1,540,710.00	0.35
95	300481	濮阳惠成	110,700	1,527,660.00	0.35
96	000921	海信家电	47,000	1,515,280.00	0.35
97	00995	安徽皖通高速公路	146,000	1,245,899.47	0.29
98	600012	皖通高速	17,300	241,681.00	0.06
99	00386	中国石油化工股份	322,000	1,487,047.78	0.34
100	000922	佳电股份	123,800	1,476,934.00	0.34
101	600582	天地科技	212,000	1,460,680.00	0.34
102	000682	东方电子	132,000	1,457,280.00	0.34
103	301489	思泉新材	20,628	1,455,924.24	0.33
104	002311	海大集团	30,700	1,444,435.00	0.33
105	600256	广汇能源	215,400	1,443,180.00	0.33
106	603279	景津装备	66,200	1,435,878.00	0.33
107	002533	金杯电工	143,500	1,427,825.00	0.33

108	002299	圣农发展	103,800	1,415,832.00	0.33
109	002073	软控股份	190,400	1,407,056.00	0.32
110	600487	亨通光电	88,100	1,389,337.00	0.32
111	000807	云铝股份	102,700	1,387,477.00	0.32
112	01898	中煤能源	166,000	1,381,724.51	0.32
113	600612	老凤祥	23,700	1,379,103.00	0.32
114	600547	山东黄金	49,900	1,366,262.00	0.31
115	600660	福耀玻璃	28,400	1,360,360.00	0.31
116	000933	神火股份	67,200	1,359,456.00	0.31
117	605196	华通线缆	128,493	1,351,746.36	0.31
118	300750	宁德时代	7,460	1,343,023.80	0.31
119	603298	杭叉集团	68,320	1,341,804.80	0.31
120	605377	华旺科技	100,100	1,326,325.00	0.31
121	00700	腾讯控股	3,900	1,325,539.92	0.30
122	600483	福能股份	113,000	1,317,580.00	0.30
123	002595	豪迈科技	33,600	1,282,512.00	0.30
124	00762	中国联通	194,000	1,269,519.63	0.29
125	605060	联德股份	87,000	1,250,190.00	0.29
126	600183	生益科技	59,200	1,246,752.00	0.29
127	300389	艾比森	99,700	1,224,316.00	0.28
128	601369	陕鼓动力	150,500	1,207,010.00	0.28
129	600026	中远海能	52,200	814,842.00	0.19
130	01138	中远海能	42,000	388,692.16	0.09
131	000997	新大陆	85,100	1,183,741.00	0.27
132	603199	九华旅游	39,300	1,171,140.00	0.27
133	000403	派林生物	43,000	1,146,380.00	0.26
134	688378	奥来德	47,520	1,114,819.20	0.26
135	600160	巨化股份	46,200	1,114,806.00	0.26
136	601666	平煤股份	99,200	1,111,040.00	0.26
137	00038	第一拖拉机 股份	164,000	1,106,131.65	0.25
138	600323	瀚蓝环境	52,900	1,105,610.00	0.25
139	600970	中材国际	90,800	1,095,048.00	0.25
140	600741	华域汽车	64,800	1,061,424.00	0.24
141	002749	国光股份	69,981	1,052,514.24	0.24
142	600422	昆药集团	58,900	1,050,187.00	0.24
143	603198	迎驾贡酒	18,100	1,040,750.00	0.24
144	600511	国药股份	33,500	1,031,465.00	0.24
145	600584	长电科技	32,324	1,024,994.04	0.24
146	605368	蓝天燃气	75,100	1,024,364.00	0.24
147	000923	河钢资源	58,500	1,007,370.00	0.23
148	300274	阳光电源	16,240	1,007,367.20	0.23
149	00916	龙源电力	157,000	1,005,901.14	0.23

150	600998	九州通	205,808	1,004,343.04	0.23
151	600580	卧龙电驱	82,600	1,003,590.00	0.23
152	301367	怡和嘉业	16,100	1,001,420.00	0.23
153	600497	驰宏锌锗	183,000	977,220.00	0.22
154	000829	天音控股	105,700	959,756.00	0.22
155	002831	裕同科技	37,000	946,830.00	0.22
156	000400	许继电气	27,000	929,070.00	0.21
157	600529	山东药玻	36,600	927,444.00	0.21
158	603087	甘李药业	19,200	889,344.00	0.20
159	600415	小商品城	119,100	883,722.00	0.20
160	002984	森麒麟	36,120	870,130.80	0.20
161	001914	招商积余	86,600	867,732.00	0.20
162	002675	东诚药业	70,000	858,200.00	0.20
163	002594	比亚迪	3,400	850,850.00	0.20
164	603979	金诚信	16,800	848,904.00	0.20
165	688012	中微公司	6,007	848,548.82	0.20
166	603915	国茂股份	82,200	845,838.00	0.19
167	002080	中材科技	64,200	828,180.00	0.19
168	600428	中远海特	133,300	815,796.00	0.19
169	00902	华能国际电 力股份	154,000	813,800.25	0.19
170	300347	泰格医药	16,700	811,620.00	0.19
171	000100	TCL 科技	184,527	797,156.64	0.18
172	002429	兆驰股份	164,500	791,245.00	0.18
173	688073	毕得医药	25,821	768,949.38	0.18
174	600312	平高电气	39,400	766,330.00	0.18
175	603606	东方电缆	15,500	756,555.00	0.17
176	06198	青岛港	138,000	750,661.05	0.17
177	601138	工业富联	27,200	745,280.00	0.17
178	003000	劲仔食品	60,800	732,640.00	0.17
179	601111	中国国航	98,500	726,930.00	0.17
180	600025	华能水电	67,000	722,260.00	0.17
181	600522	中天科技	45,100	714,835.00	0.16
182	603297	永新光学	11,800	713,782.00	0.16
183	002353	杰瑞股份	20,100	705,108.00	0.16
184	01585	雅迪控股	78,000	702,635.82	0.16
185	300181	佐力药业	46,000	695,520.00	0.16
186	000060	中金岭南	161,900	686,456.00	0.16
187	601168	西部矿业	37,400	671,330.00	0.15
188	600674	川投能源	35,700	669,375.00	0.15
189	601333	广深铁路	203,100	658,044.00	0.15
190	688799	华纳药厂	15,423	654,397.89	0.15
191	688019	安集科技	5,101	641,705.80	0.15

192	600096	云天化	33,000	640,860.00	0.15
193	300748	金力永磁	48,640	630,374.40	0.15
194	002063	远光软件	118,700	621,988.00	0.14
195	600060	海信视像	25,100	620,974.00	0.14
196	300628	亿联网络	16,580	609,646.60	0.14
197	688789	宏华数科	5,631	607,021.80	0.14
198	600519	贵州茅台	400	586,956.00	0.14
199	002839	张家港行	145,100	583,302.00	0.13
200	603619	中曼石油	24,800	580,816.00	0.13
201	600963	岳阳林纸	151,900	557,473.00	0.13
202	002223	鱼跃医疗	14,300	537,680.00	0.12
203	600916	中国黄金	55,600	534,872.00	0.12
204	601801	皖新传媒	76,100	527,373.00	0.12
205	603588	高能环境	83,800	526,264.00	0.12
206	300251	光线传媒	61,500	517,215.00	0.12
207	00586	海螺创业	75,500	501,645.44	0.12
208	01910	新秀丽	23,400	497,611.39	0.11
209	688150	莱特光电	25,455	493,827.00	0.11
210	688398	赛特新材	28,075	493,558.50	0.11
211	603368	柳药集团	28,100	491,750.00	0.11
212	603811	诚意药业	77,000	481,250.00	0.11
213	603566	普莱柯	35,400	480,732.00	0.11
214	002738	中矿资源	17,840	478,112.00	0.11
215	603239	浙江仙通	34,800	477,108.00	0.11
216	605507	国邦医药	27,500	457,875.00	0.11
217	300529	健帆生物	16,500	448,965.00	0.10
218	00631	三一国际	101,000	447,998.10	0.10
219	002035	华帝股份	70,600	439,838.00	0.10
220	002557	洽洽食品	15,500	436,945.00	0.10
221	03690	美团-W	4,290	435,000.63	0.10
222	688377	迪威尔	33,178	434,631.80	0.10
223	600968	海油发展	105,200	433,424.00	0.10
224	601827	三峰环境	50,800	431,292.00	0.10
225	002463	沪电股份	11,600	423,400.00	0.10
226	300677	英科医疗	15,600	418,236.00	0.10
227	688696	极米科技	4,896	378,167.04	0.09
228	601816	京沪高铁	69,200	371,604.00	0.09
229	688210	统联精密	16,742	370,835.30	0.09
230	688692	达梦数据	1,675	367,528.90	0.08
231	300394	天孚通信	3,680	325,385.60	0.07
232	600176	中国巨石	28,200	311,610.00	0.07
233	000538	云南白药	5,900	301,785.00	0.07
234	603738	泰晶科技	20,220	275,800.80	0.06

235	600420	国药现代	24,400	260,592.00	0.06
236	603565	中谷物流	28,700	250,838.00	0.06
237	688668	鼎通科技	6,353	249,609.37	0.06
238	600845	宝信软件	7,543	240,847.99	0.06
239	603179	新泉股份	6,000	235,440.00	0.05
240	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.05
241	09992	泡泡玛特	6,600	230,406.07	0.05
242	688612	威迈斯	8,580	227,970.60	0.05
243	301261	恒工精密	5,800	215,006.00	0.05
244	603885	吉祥航空	18,900	207,711.00	0.05
245	301580	爱迪特	2,018	153,513.06	0.04
246	300174	元力股份	10,500	143,325.00	0.03
247	603878	武进不锈	21,200	138,648.00	0.03
248	301565	中仑新材	5,103	124,041.42	0.03
249	603129	春风动力	600	85,404.00	0.02
250	688190	云路股份	1,079	80,612.09	0.02
251	603381	永臻股份	1,778	49,273.14	0.01
252	001286	陕西能源	3,767	43,433.51	0.01
253	301526	国际复材	9,723	32,377.59	0.01
254	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
255	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
256	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
257	601096	宏盛华源	3,918	16,024.62	0.00
258	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
259	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
260	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.00
261	301516	中远通	604	11,252.52	0.00
262	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
263	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
264	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
265	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
266	688456	有研粉材	338	9,014.46	0.00
267	301459	丰茂股份	208	8,259.68	0.00
268	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
269	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
270	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
271	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
272	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
273	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
274	603193	润本股份	303	5,572.17	0.00
275	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
276	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
277	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00

278	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
279	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
280	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
281	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
282	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
283	688269	凯立新材	123	3,142.65	0.00
284	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
285	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
286	000708	中信特钢	200	2,714.00	0.00
287	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
288	001239	永达股份	189	2,623.32	0.00
289	001358	兴欣新材	122	2,503.44	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	001965	招商公路	13,296,000.34	1.82
2	601225	陕西煤业	9,011,332.96	1.24
3	000521	长虹美菱	8,552,041.34	1.17
4	601699	潞安环能	6,361,973.00	0.87
5	600900	长江电力	5,521,025.00	0.76
6	000429	粤高速 A	4,475,386.00	0.61
7	600985	淮北矿业	4,417,153.00	0.61
8	600690	海尔智家	3,942,077.12	0.54
9	600482	中国动力	3,852,568.00	0.53
10	601088	中国神华	3,606,126.00	0.49
11	002128	电投能源	3,496,347.00	0.48
12	000425	徐工机械	3,222,498.00	0.44
13	601077	渝农商行	3,217,647.00	0.44
14	600971	恒源煤电	3,182,870.00	0.44
15	301004	嘉益股份	2,828,708.44	0.39
16	601006	大秦铁路	2,786,746.00	0.38
17	000338	潍柴动力	2,768,134.00	0.38
18	600188	兖矿能源	2,736,369.50	0.38
19	600027	华电国际	2,707,783.00	0.37
20	600873	梅花生物	2,649,817.00	0.36

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	001965	招商公路	14,483,249.05	1.99
2	601225	陕西煤业	6,468,109.00	0.89
3	601006	大秦铁路	6,016,180.00	0.83
4	002128	电投能源	5,984,813.00	0.82
5	600900	长江电力	5,433,283.00	0.75
6	600012	皖通高速	5,045,415.00	0.69
7	000975	山金国际	4,889,383.00	0.67
8	000521	长虹美菱	4,364,256.00	0.60
9	603337	杰克股份	4,236,572.00	0.58
10	603979	金诚信	4,062,669.00	0.56
11	601567	三星医疗	3,910,151.00	0.54
12	601699	潞安环能	3,436,053.00	0.47
13	688737	中自科技	3,432,650.49	0.47
14	600546	山煤国际	3,349,980.00	0.46
15	000429	粤高速 A	3,240,487.00	0.44
16	002749	国光股份	3,234,519.00	0.44
17	600027	华电国际	3,228,947.00	0.44
18	002318	久立特材	3,160,385.00	0.43
19	600707	彩虹股份	3,107,153.00	0.43
20	600188	兖矿能源	2,945,850.00	0.40

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	278,400,942.70
卖出股票收入（成交）总额	411,941,858.32

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	9,851,466.16	2.27
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）	796,022.29	0.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,647,488.45	2.45

## 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	019709	23 国债 16	97,000	9,851,466.16	2.27
2	110091	合力转债	2,560	412,583.28	0.09
3	113669	景 23 转债	1,290	170,701.11	0.04
4	118024	冠宇转债	1,200	131,584.77	0.03
5	113675	新 23 转债	700	81,153.13	0.02

## 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

无。

## 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**

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

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

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

## 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	252,404.85
2	应收清算款	16,710,458.11
3	应收股利	660,226.27
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,623,089.23

## 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	110091	合力转债	412,583.28	0.09
2	113669	景 23 转债	170,701.11	0.04
3	118024	冠宇转债	131,584.77	0.03
4	113675	新 23 转债	81,153.13	0.02

## 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
南方鑫悦 15 个月持有混合 A	4,162	104,545.69	167,997.52	0.04%	434,951,145.23	99.96%
南方鑫悦 15 个月持有混合 C	165	52,319.77	-	-	8,632,761.67	100.00%
合计	4,327	102,554.17	167,997.52	0.04%	443,583,906.90	99.96%

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	南方鑫悦 15 个月持有混合 A	39,009.50	0.0090%
	南方鑫悦 15 个月持有混合 C	-	-
	合计	39,009.50	0.0088%

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	南方鑫悦 15 个月持有混合 A	0
	南方鑫悦 15 个月持有混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方鑫悦 15 个月持有混合 A	0~10
	南方鑫悦 15 个月持有混合 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方鑫悦 15 个月持有混合 A	南方鑫悦 15 个月持有混合 C
基金合同生效日(2022 年 9 月 14 日)基金份额总额	957,594,119.38	26,243,165.32
本报告期期初基金份额总额	741,926,439.32	18,630,006.01
本报告期基金总申购份额	1,077,059.67	11.43
减：报告期基金总赎回份额	307,884,356.24	9,997,255.77
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	435,119,142.75	8,632,761.67

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

### 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，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

2024 年 2 月 7 日，本基金托管人南京银行股份有限公司法定代表人变更为谢宁先生。

### 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	
中泰证券	2	688,547,339.73	100.00%	295,835.27	100.00%	-

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

A：选择标准

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

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

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

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

无

减少交易单元：

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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例		证成交总 额的比例
中泰证券	741,083.80	100.00%	17,216,000.00	100.00%	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方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	2024-01-06
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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-02
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-24
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-30
6	南方基金管理股份有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-20

## § 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鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方鑫悦 15 个月持有期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、《南方鑫悦 15 个月持有期混合型证券投资基金 2024 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>