

# 南方利淘灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2021 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 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 2021 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.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	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.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.12 投资组合报告附注 .....	46
§8 基金份额持有人信息 .....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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 .....	48
§9 开放式基金份额变动 .....	48
§10 重大事件揭示 .....	49
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
§12 备查文件目录 .....	53
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方利淘灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	南方利淘灵活配置混合	
基金主代码	001183	
交易代码	001183	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 4 月 17 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,024,277,664.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方利淘 A 类	南方利淘 C 类
下属分级基金的交易代码	001183	001504
报告期末下属分级基金的份 额总额	962,953,864.08 份	61,323,800.74 份

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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析及投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析各种金融工具的定价，挖掘定价错配的机会，并据此制定本基金在股票、债券、现金、金融衍生品等资产之间的调整原则、配置比例和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳健增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：人民币三年期定期存款利率（税后）+2%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
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	95580
		tiandonghui@psbc.com

传真	0755-82763889	010-68858120
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区金融大街 3 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	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	518017	100808
法定代表人	杨小松（代为履行法定代表人职责）	张金良

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务（包括代为履行公司法定代表人职责以及法定、公司章程和制度规定的公司董事长其他各项职责）。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

#### 1、南方利淘 A 类

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	37,885,835.75
本期利润	30,301,168.08
加权平均基金份额本期利润	0.0603
本期加权平均净值利润率	3.91%

本期基金份额净值增长率	3.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	473,406,679.81
期末可供分配基金份额利润	0.4916
期末基金资产净值	1,513,009,233.78
期末基金份额净值	1.571
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	57.10%

## 2、南方利淘 C 类

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	1,029,977.66
本期利润	831,426.22
加权平均基金份额本期利润	0.0481
本期加权平均净值利润率	3.11%
本期基金份额净值增长率	3.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	30,620,528.64
期末可供分配基金份额利润	0.4993
期末基金资产净值	96,190,753.94
期末基金份额净值	1.569
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	47.02%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

4、本基金从2015年6月18日起新增C类份额，C类份额自2015年11月10日起存续。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方利淘 A 类

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.51%	0.12%	0.30%	0.01%	0.21%	0.11%
过去三个月	3.36%	0.20%	0.92%	0.01%	2.44%	0.19%
过去六个月	3.90%	0.33%	1.85%	0.01%	2.05%	0.32%
过去一年	15.68%	0.38%	3.80%	0.01%	11.88%	0.37%
过去三年	37.81%	0.29%	12.35%	0.01%	25.46%	0.28%
自基金合同 生效起至今	57.10%	0.21%	29.77%	0.01%	27.33%	0.20%

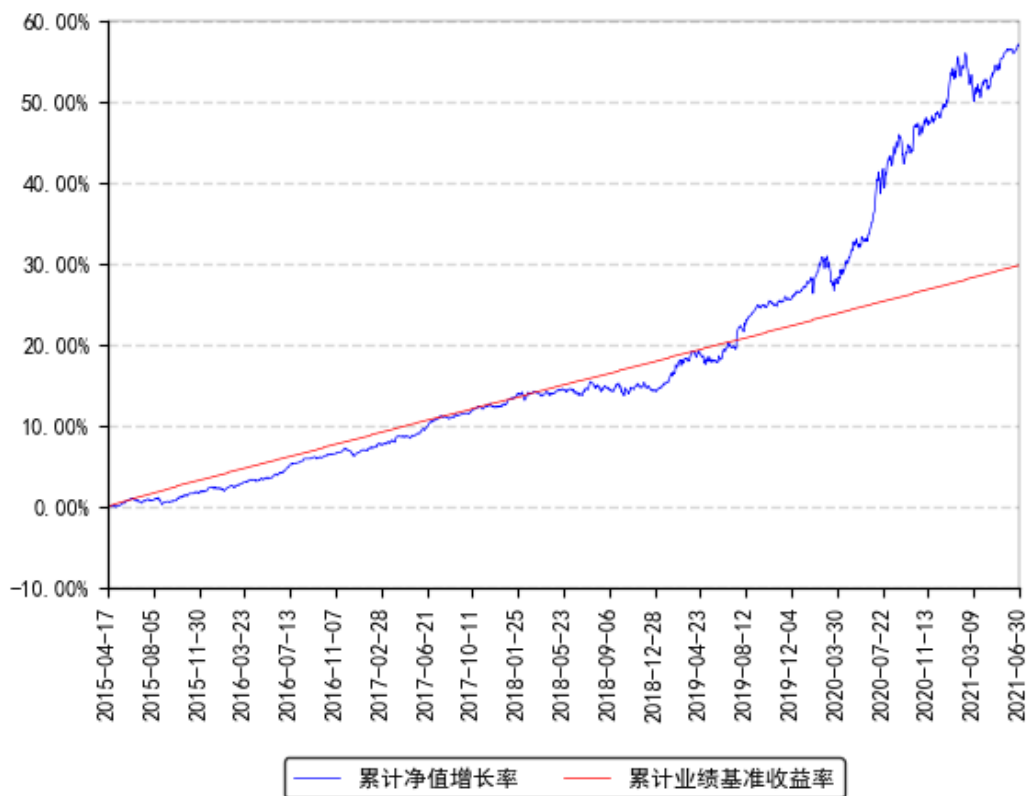
南方利淘 C 类

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.51%	0.12%	0.32%	0.01%	0.19%	0.11%
过去三个月	3.36%	0.20%	0.97%	0.01%	2.39%	0.19%
过去六个月	3.91%	0.33%	1.96%	0.01%	1.95%	0.32%
过去一年	15.71%	0.38%	4.03%	0.01%	11.68%	0.37%
过去三年	37.63%	0.29%	13.15%	0.01%	24.48%	0.28%
自基金合同 生效起至今	47.02%	0.24%	22.73%	0.01%	24.29%	0.23%

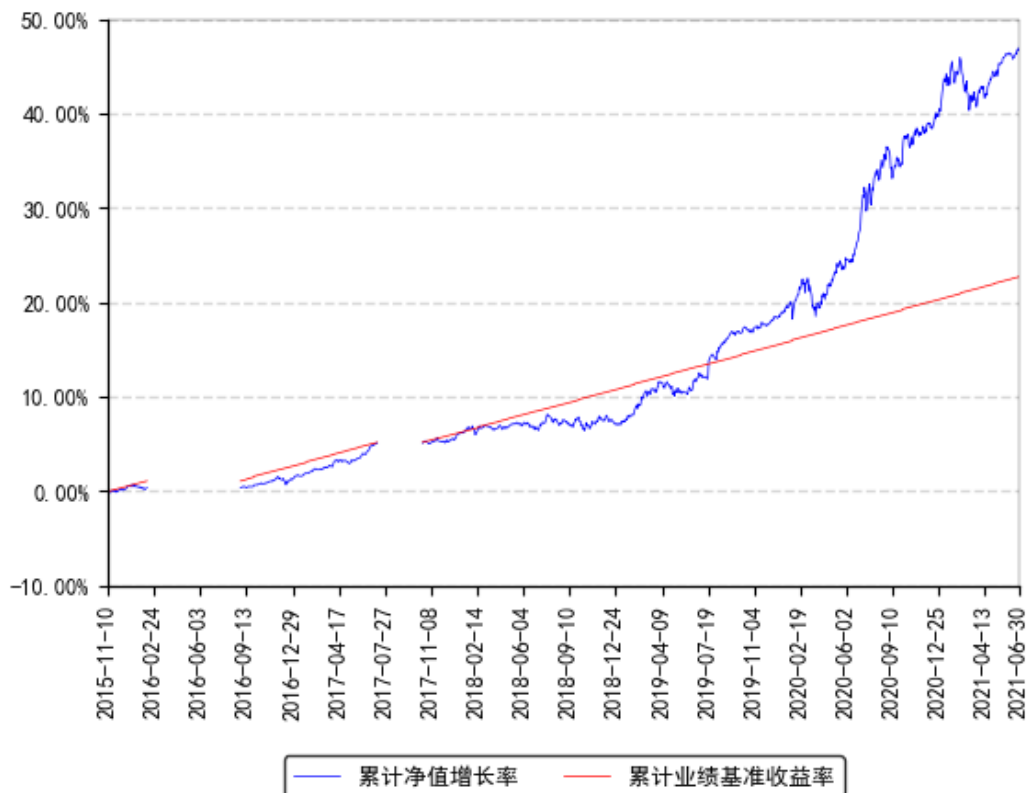
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



南方利淘A类累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方利淘C类累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金从 2015 年 6 月 18 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2015 年 11 月 10 日起存续。

## § 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。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙) 2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙) 2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙) 2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙) 2.20%。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。

截至本报告期末，南方基金管理股份有限公司(不含子公司)管理资产规模超过 1.4 万亿元，旗下管理 245 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

#### 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		
陈乐	本基金基金经理	2019 年 1 月 25 日	-	12 年	北京大学金融学硕士，特许金融分析师(CFA)，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；2016 年 2 月 23 日至 2017 年 12 月 30 日，任南方避险、南方平衡配置(原：南方保本)、南方利淘、南方利鑫、南方丰合、南方益和、南方瑞利的基金经理助理；2016 年 10 月 18 日至 2017 年 12 月 30 日，任南方安泰养老基金经理助理；2016 年 12 月 23 日至 2017 年 12 月 30 日，任南方安裕养老基金经

				理助理；2017 年 8 月 22 日至 2017 年 12 月 30 日，任南方安睿混合基金经理助理。2018 年 6 月 8 日至 2019 年 12 月 21 日，任南方睿见混合基金经理；2018 年 11 月 5 日至 2020 年 4 月 1 日，任南方固胜定期开放混合基金经理；2019 年 6 月 21 日至 2021 年 1 月 21 日，任南方共享经济混合基金经理；2018 年 1 月 29 日至 2021 年 4 月 22 日，任南方融尚再融资基金经理；2017 年 12 月 30 日至今，任南方瑞利混合基金经理；2019 年 1 月 25 日至今，任南方利淘、南方利鑫基金经理；2020 年 6 月 10 日至今，任南方誉丰 18 个月混合基金经理；2020 年 11 月 10 日至今，任南方誉尚一年持有期混合基金经理；2021 年 3 月 23 日至今，任南方宝顺混合基金经理；2021 年 4 月 7 日至今，任南方誉享一年持有期混合基金经理；2021 年 4 月 13 日至今，任南方誉隆一年持有期混合基金经理；2021 年 4 月 29 日至今，任南方誉浦一年持有混合基金经理。
--	--	--	--	---

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券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遵规守信情况的说明

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，未出现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% 的情况。

### 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

2021 年上半年，国内经济数据处于较好水平，PMI 指数位于荣枯线上方。

2021 年上半年，沪深 300 收于 5224.04 点，半年度涨跌幅 0.24%，创业板指收于 3477.18 点，半年度涨跌幅 17.22%。分行业来看，基础化工、钢铁、电力设备及新能源、综合等行业表现较好，非银行金融、家电、国防军工、房地产等行业表现较差。2021 年上半年，国内固定收益市场震荡。一年期国债到期收益率下降 4bp，一年期 AAA 信用债到期收益率下降 17bp。

本基金股票部分主要投资于低估值高分红的价值股，通过持有此类个股在控制组合下行风险的前提下提升组合的整体收益率。与此同时，股票部分也重点配置稳定成长行业中的优质个股，跟踪验证公司季报的财务数据。具体的个股选择上，本基金重点考察公司的盈利增长、净资产收益率，分析公司的商业模式、竞争优势以及可持续性，关注公司现金流情况及治理结构。

具体而言，我们在成熟行业比较重视公司的 ROE 指标。ROE 是公司商业模式、竞争优势、公司治理等等的综合结果，表征公司的盈利质量及潜在增长率。成熟行业的公司各项财务指标相对稳定，如果市场给予的估值也相对稳定，那么公司财务指标的增长通过估值指标反映到股价上，ROE 就接近持有股票的回报率。如果将投资范围从成熟行业放宽到宽基指数，将投资时间拉长，那么由于市场的估值是均值回归的，长期来看估值变化引起的股价波动年化下来不再显著，宽基指数的长期回报率接近于 ROE 水平。在成长及周期行业中，由于公司的 ROE 尚未稳定下来，我们主要利用景气投资的方法寻找高景气的成长行业或者景气反转的周期行业。行业、板块景气程度的变化往往会造成市场风格的变化，我们通过跟踪季报期各行业的收入、利润增速，寻找景气度较高或景气度变化较大的行业进行投资。

背后的逻辑在于，一个行业的高景气度往往会持续若干个季度，如果可以较早发现这一趋势，后面会有较长时间享受盈利的超额增长。

固定收益投资上，本基金希望固定收益资产起到提供相对稳定的回报、平滑组合回撤的作用，因此更加注重安全性，主要投资于中高评级的信用债、货币市场工具，以持有到期策略为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.571 元，报告期内，份额净值增长率为 3.90%，同期业绩基准增长率为 1.85%；本基金 C 份额净值为 1.569 元，报告期内，份额净值增长率为 3.91%，同期业绩基准增长率为 1.96%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票是金融资产中长期表现最优秀的资产之一，长期收益率可以显著跑赢通胀。虽然中国的人口红利期接近结束，经济中长期增速面临下调，但从成熟经济体历史来看，类似时期往往伴随无风险利率的下行以及股票市场的上行。从资产配置的角度来看，中国居民的资产配置中金融资产占比过低，在国家提升金融市场定位、坚持房住不炒的政策导向的背景下，未来有逐步提升金融资产配置比重的需求。我们对股票市场的长期收益率仍然相对乐观。

资本市场制度创新层面，我们认为创业板注册制及巨额 IPO 的推行一方面为市场带来了资金压力，另一方面也为市场提供了更优质的供给，新股将有更多估值回归机会。从产业趋势看，经济增速下台阶后，新业态往往会以更迅猛的方式成为市场的主流，为资本市场带来更大机遇。未来市场将会持续受益于资本市场的制度创新。这些政策的落地有望拓宽资本市场的广度及深度，并带来持续的增量资金。

展望未来，我们认为股票市场当前估值基本合理，市场整体的估值提升过程告一段落，未来本基金将以均衡配置为主，主要寻找盈利驱动的个股和行业进行投资。

### 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、指数投资部总经理、现金投资部总经理、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

本基金基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在南方利淘灵活配置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，对本基金管理人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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、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：南方利淘灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	13,100,144.03	5,722,103.55
结算备付金		21,898,957.09	1,593,046.32
存出保证金		130,366.33	155,155.25
交易性金融资产	6.4.3.2	1,340,794,846.93	590,537,504.71
其中：股票投资		238,083,827.39	142,586,608.51
基金投资		-	-
债券投资		1,102,711,019.54	447,950,896.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	225,000,000.00	3,000,000.00
应收证券清算款		-	1,068,176.80
应收利息	6.4.3.5	12,379,999.52	5,886,135.93
应收股利		-	-
应收申购款		5,861,594.79	303,593.04
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		1,619,165,908.69	608,265,715.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	13,000,000.00
应付证券清算款		5,445,607.44	2,989,623.31
应付赎回款		3,270,439.27	303,484.81
应付管理人报酬		754,943.46	301,550.71
应付托管费		125,823.93	50,258.44
应付销售服务费		7,480.74	1,912.61
应付交易费用	6.4.3.7	216,770.16	148,545.02
应交税费		57,800.37	51,271.04
应付利息		-	4,460.97
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	87,055.60	170,295.90
负债合计		9,965,920.97	17,021,402.81
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	1,024,277,664.82	390,929,144.65
未分配利润	6.4.3.10	584,922,322.90	200,315,168.14
所有者权益合计		1,609,199,987.72	591,244,312.79
负债和所有者权益总计		1,619,165,908.69	608,265,715.60

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，南方利淘 A 类份额净值 1.571 元，基金份额总额 962,953,864.08 份；南方利淘 C 类份额净值 1.569 元，基金份额总额 61,323,800.74 份；总份额合计 1,024,277,664.82 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方利淘灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日



单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		34,692,626.07	40,860,895.80
1. 利息收入		10,338,195.61	8,718,256.49
其中：存款利息收入	6.4.3.11	133,925.15	43,102.60
债券利息收入		9,040,195.68	8,649,712.15
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,164,074.78	25,441.74
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		31,891,825.32	17,818,600.54
其中：股票投资收益	6.4.3.12	31,858,740.53	16,220,152.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-1,181,613.64	805,620.05
资产支持证券投资	6.4.3.14	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.3.15	-	-
衍生工具收益	6.4.3.16	-	-
股利收益	6.4.3.17	1,214,698.43	792,828.19
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	-7,783,219.11	14,298,731.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	245,824.25	25,306.93
减：二、费用		3,560,031.77	3,095,582.02
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	2,351,863.18	1,689,735.49
2. 托管费	6.4.6.2.2	391,977.26	281,622.58

3. 销售服务费	6. 4. 6. 2. 3	12, 860. 38	23, 954. 04
4. 交易费用	6. 4. 3. 20	599, 066. 81	683, 262. 20
5. 利息支出		73, 215. 90	279, 226. 08
其中：卖出回购金融资产支出		73, 215. 90	279, 226. 08
6. 税金及附加		28, 145. 68	29, 674. 03
7. 其他费用	6. 4. 3. 21	102, 902. 56	108, 107. 60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31, 132, 594. 30	37, 765, 313. 78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31, 132, 594. 30	37, 765, 313. 78

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方利淘灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	390, 929, 144. 65	200, 315, 168. 14	591, 244, 312. 79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31, 132, 594. 30	31, 132, 594. 30
三、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）	633, 348, 520. 17	353, 474, 560. 46	986, 823, 080. 63
其中：1. 基金申购款	971, 513, 783. 28	541, 877, 884. 96	1, 513, 391, 668. 24
2. 基金赎回款	-338, 165, 263. 11	-188, 403, 324. 50	-526, 568, 587. 61
四、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)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,024,277,664.82	584,922,322.90	1,609,199,987.72
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	461,116,862.13	124,420,552.80	585,537,414.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	37,765,313.78	37,765,313.78
三、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)	-38,610,552.43	-11,030,950.25	-49,641,502.68
其中：1. 基金申购款	8,826,044.44	2,650,997.63	11,477,042.07
2. 基金赎回款	-47,436,596.87	-13,681,947.88	-61,118,544.75
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	422,506,309.70	151,154,916.33	573,661,226.03

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 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	13,100,144.03
定期存款	-
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	-
合计	13,100,144.03

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	205,447,896.13	238,083,827.39	32,635,931.26
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	613,705,470.93	612,253,019.54
	银行间市场	490,998,539.38	490,458,000.00
	合计	1,104,704,010.31	1,102,711,019.54
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,310,151,906.44	1,340,794,846.93	30,642,940.49

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

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 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	225,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	225,000,000.00	-

**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 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,111.02
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	9,854.50
应收债券利息	12,366,975.40
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	58.60
合计	12,379,999.52

**6.4.3.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.3.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	213,870.16
银行间市场应付交易费用	2,900.00
合计	216,770.16

**6.4.3.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,753.04
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,302.56
合计	87,055.60

**6.4.3.9 实收基金**

金额单位：人民币元

南方利淘 A 类	
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	384,495,377.96	384,495,377.96
本期申购	910,967,236.71	910,967,236.71
本期赎回（以“-”号填列）	-332,508,750.59	-332,508,750.59
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	962,953,864.08	962,953,864.08

南方利淘 C 类		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,433,766.69	6,433,766.69
本期申购	60,546,546.57	60,546,546.57
本期赎回（以“-”号填列）	-5,656,512.52	-5,656,512.52
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	61,323,800.74	61,323,800.74

本期申购含转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

南方利淘 A 类			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	156,223,556.15	40,807,216.89	197,030,773.04
本期利润	37,885,835.75	-7,584,667.67	30,301,168.08
本期基金份额交易产生的变动数	279,297,287.91	43,426,140.67	322,723,428.58
其中：基金申购款	439,315,265.00	68,821,308.19	508,136,573.19
基金赎回款	-160,017,977.09	-25,395,167.52	-185,413,144.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	473,406,679.81	76,648,689.89	550,055,369.70

南方利淘 C 类			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,668,481.92	615,913.18	3,284,395.10
本期利润	1,029,977.66	-198,551.44	831,426.22
本期基金份额交易产生的变动数	26,922,069.06	3,829,062.82	30,751,131.88
其中：基金申购款	29,563,218.80	4,178,092.97	33,741,311.77

基金赎回款	-2,641,149.74	-349,030.15	-2,990,179.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,620,528.64	4,246,424.56	34,866,953.20

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	87,368.07
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	37,081.26
其他	9,475.82
合计	133,925.15

#### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	170,068,171.52
减：卖出股票成本总额	138,209,430.99
买卖股票差价收入	31,858,740.53

#### 6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	96,022,891.78
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	94,080,612.00
减：应收利息总额	3,123,893.42
买卖债券差价收入	-1,181,613.64

#### 6.4.3.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.3.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

#### 6.4.3.16 衍生工具收益

##### 6.4.3.16.1 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。

##### 6.4.3.16.2 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。

#### 6.4.3.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,214,698.43
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,214,698.43

#### 6.4.3.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-7,783,219.11
——股票投资	-7,803,150.94
——债券投资	19,931.83
——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	-7,783,219.11

#### 6.4.3.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	229,844.82
基金转换费收入	15,979.43
合计	245,824.25

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中，A 类份额将不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产，C 类份额将赎回费收入全额归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中，A 类份额将不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产，C 类份额将转出基金的赎回费全额归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.3.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------------------



交易所市场交易费用	595,791.81
银行间市场交易费用	3,275.00
合计	599,066.81

#### 6.4.3.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
合计	102,902.56

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

无。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司(“中国邮储银行”)	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、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公 司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

##### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,351,863.18	1,689,735.49
其中：支付销售机构的客户维护费	401,740.59	74,845.43

注：于 2019 年 10 月 21 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 1.00% 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 × 1.00% / 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相关基金费率并因此修订基金合同及托管协议的公告》，自 2019 年 10 月 21 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 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	391,977.26	281,622.58

注：于 2019 年 10 月 21 日前，支付基金托管人中国邮储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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 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相关基金费率并因此修订基金合同及托管协议的公告》，自 2019 年 10 月 21 日起，支付基金托管人中国邮储银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方利淘 A 类	南方利淘 C 类	合计
南方基金	-	7,216.51	7,216.51
合计	-	7,216.51	7,216.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方利淘 A 类	南方利淘 C 类	合计
南方基金	-	21,349.70	21,349.70
合计	-	21,349.70	21,349.70

注：根据《南方基金关于旗下部分混合型基金销售服务费优惠的公告》和《南方基金关于继续开展旗下部分基金销售服务费优惠的公告》，自 2015 年 6 月 25 日起，销售服务费率为 0.10% 的优惠费率，支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

**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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
中国邮储银行	13,100,144.03	87,368.07	3,814,942.20	35,731.15

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
华泰联合证券	113050	南银转债	优先配售	3,060	306,000.00
兴业证券	605086	龙高股份	网下申购	443	5,696.98
华泰联合证券	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
兴业证券	605298	必得科技	网下申购	391	6,252.09
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证券	688083	中望软件	网下申购	1,517	228,308.50
华泰联合证券	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证券	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
兴业证券	688195	腾景科技	网下申购	2,693	36,624.80
华泰联合证券	688260	昀冢科技	网下申购	2,990	28,793.70
华泰联合证券	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证券	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
兴业证券	688597	煜邦电力	网下申购	3,907	22,973.16
华泰联合证券	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31

华泰联合证券	688633	星球石墨	网下申购	1,558	52,379.96
兴业证券	688639	华恒生物	网下申购	2,302	53,314.32
兴业证券	300941	创识科技	网下申购	3,989	85,005.59
华泰联合证券	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16
兴业证券	300979	华利集团	网下申购	8,044	267,221.68

上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
华泰联合证券	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.8 期末（2021 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	创业板新股锁定期	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	创业板新股锁定期	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	创业板新股锁定期	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	创业板新股锁定期	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300941	创识科技	2021 年	2021 年	创业板	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-

		2月2日	8月9日	新股锁定期						
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	创业板新股锁定期	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板新股锁定期	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板新股锁定期	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年6月4日	2021年8月25日	锁定期转增	-	27.42	108	-	2,961.36	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	创业板新股锁定期	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	创业板新股锁定期	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	创业板新股锁定期	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	创业板新股锁定期	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	创业板新股锁定期	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	创业板新股锁定期	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	创业板新股锁定期	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	创业板新股锁定期	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	创业板新股锁定期	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	创业板新股锁定期	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-

300979	华利集团	2021年 4月15 日	2021年 10月26 日	创业板 新股锁 定期	33.22	87.50	805	26,742.10	70,437.50	-
300981	中红医疗	2021年 4月19 日	2021年 10月27 日	创业板 新股锁 定期	48.59	90.39	502	24,392.18	45,375.78	-
300982	苏文电能	2021年 4月19 日	2021年 10月27 日	创业板 新股锁 定期	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年 4月21 日	2021年 10月29 日	创业板 新股锁 定期	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300987	川网传媒	2021年 4月28 日	2021年 11月11 日	创业板 新股锁 定期	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300992	泰福泵业	2021年 5月17 日	2021年 11月25 日	创业板 新股锁 定期	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年 5月17 日	2021年 11月24 日	创业板 新股锁 定期	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年 5月17 日	2021年 11月26 日	创业板 新股锁 定期	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年 5月26 日	2021年 12月3 日	创业板 新股锁 定期	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年 5月26 日	2021年 12月2 日	创业板 新股锁 定期	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年 5月25 日	2021年 12月2 日	创业板 新股锁 定期	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年 5月27 日	2021年 12月7 日	创业板 新股锁 定期	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021年 6月4 日	2021年 12月16 日	创业板 新股锁 定期	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021年 6月8 日	2021年 12月17 日	创业板 新股锁 定期	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021年 6月9 日	2021年 12月20 日	创业板 新股锁	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

		日	日	定期						
301011	华立科技	2021年 6月9 日	2021年 12月17 日	创业板 新股锁 定期	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年 6月15 日	2021年 12月22 日	创业板 新股锁 定期	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年 6月21 日	2021年 12月29 日	创业板 新股锁 定期	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年 6月22 日	2021年 12月30 日	创业板 新股锁 定期	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
605162	新中港	2021年 6月29 日	2021年 7月7 日	新股未 上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021年 6月30 日	2021年 7月9 日	新股未 上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688161	威高骨科	2021年 6月23 日	2021年 12月30 日	科创板 新股锁 定期	36.22	82.27	3,069	111,159.18	252,486.63	-
688226	威腾电气	2021年 6月28 日	2021年 7月7 日	新股未 上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021年 6月25 日	2021年 7月5 日	新股未 上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688269	凯立新材	2021年 6月1 日	2021年 12月9 日	科创板 新股锁 定期	18.94	100.9 2	1,941	36,762.54	195,885.72	-
688383	新益昌	2021年 4月21 日	2021年 10月28 日	科创板 新股锁 定期	19.58	106.2 4	2,701	52,885.58	286,954.24	-
688517	金冠电气	2021年	2021年	科创板	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-



		6月10日	12月20日	新股锁定期						
688533	上声电子	2021年4月9日	2021年10月19日	科创板新股锁定期	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688669	聚石化学	2021年1月15日	2021年7月26日	科创板新股锁定期	36.65	32.39	2,681	98,258.65	86,837.59	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	创业板新股锁定期	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
113049	长汽转债	2021年6月11日	2021年7月8日	配债未上市	100.00	100.00	360	36,000.00	36,000.00	-
113050	南银转债	2021年6月16日	2021年7月1日	配债未上市	100.00	100.00	3,060	306,000.00	306,000.00	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%，且自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起6个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东及董事、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自

发行人股票上市之日起 6 个月。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。

3、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

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**

无。

#### **6.4.9 金融工具风险及管理**

##### **6.4.9.1 风险管理政策和组织架构**

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员

会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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

#### 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邮储银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

#### 6.4.9.3 流动性风险

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

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.9.3.1 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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 2021 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

#### 6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率

类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

#### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	13,100,144.03	-	-	-	13,100,144.03
结算备付金	21,898,957.09	-	-	-	21,898,957.09
存出保证金	130,366.33	-	-	-	130,366.33
交易性金融资产	332,368,775.70	769,788,900.00	553,343.84	238,083,827.39	1,340,794,846.93
买入返售金融资产	225,000,000.00	-	-	-	225,000,000.00
应收利息	-	-	-	12,379,999.52	12,379,999.52
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	154.00	-	-	5,861,440.79	5,861,594.79
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	592,498,397.15	769,788,900.00	553,343.84	256,325,267.70	1,619,165,908.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,270,439.27	3,270,439.27
应付管理人报酬	-	-	-	754,943.46	754,943.46
应付托管费	-	-	-	125,823.93	125,823.93
应付证券清算款	-	-	-	5,445,607.44	5,445,607.44
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服	-	-	-	7,480.74	7,480.74

务费					
应付交易费用	-	-	-	216,770.16	216,770.16
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	57,800.37	57,800.37
其他负债	-	-	-	87,055.60	87,055.60
负债总计	-	-	-	9,965,920.97	9,965,920.97
利率敏感度缺口	592,498,397.15	769,788,900.00	553,343.84	246,359,346.73	1,609,199,987.72
上年度末 2020 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	5,722,103.55	-	-	-	5,722,103.55
结算备付金	1,593,046.32	-	-	-	1,593,046.32
存出保证金	155,155.25	-	-	-	155,155.25
交易性金融资产	201,947,996.20	246,002,900.00	-	142,586,608.51	590,537,504.71
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应收利息	-	-	-	5,886,135.93	5,886,135.93
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	31,069.51	-	-	272,523.53	303,593.04
应收证券清算款	-	-	-	1,068,176.80	1,068,176.80
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	212,449,370.83	246,002,900.00	-	149,813,444.77	608,265,715.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	303,484.81	303,484.81
应付管理人报酬	-	-	-	301,550.71	301,550.71
应付托管费	-	-	-	50,258.44	50,258.44
应付证券清算款	-	-	-	2,989,623.31	2,989,623.31
卖出回购金融资产款	13,000,000.00	-	-	-	13,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	1,912.61	1,912.61
应付交易费用	-	-	-	148,545.02	148,545.02
应付利息	-	-	-	4,460.97	4,460.97

应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	51,271.04	51,271.04
其他负债	-	-	-	170,295.90	170,295.90
负债总计	13,000,000.00	-	-	4,021,402.81	17,021,402.81
利率敏感度缺口	199,449,370.83	246,002,900.00	-	145,792,041.96	591,244,312.79

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(2021年6月30日)	上年度末(2020年12月31日)
	1.市场利率平行上升25个基点	-4,396,949.24	-1,694,042.32
	2.市场利率平行下降25个基点	4,432,005.35	1,708,867.77

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,通过对宏观经济情况及政策的分析,结合证券市场运行情况,做出资产配置及组合构建的决定;通过对单个证券的定性分析及定量分析,选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化,对投资策略、资产配置、投资组合进行修正,来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为:本基金股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例范围0-95%。债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产净值的5%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行

风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	238,083,827.39	14.80	142,586,608.51	24.12
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	238,083,827.39	14.80	142,586,608.51	24.12

#### 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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 上升 5%	11,711,841.58	6,927,336.44
	2. 沪深 300 下降 5%	-11,711,841.58	-6,927,336.44

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

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	238,083,827.39	14.70
	其中：股票	238,083,827.39	14.70
2	基金投资	-	-



3	固定收益投资	1,102,711,019.54	68.10
	其中：债券	1,102,711,019.54	68.10
	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	225,000,000.00	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	34,999,101.12	2.16
8	其他资产	18,371,960.64	1.13
9	合计	1,619,165,908.69	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	16,192,846.80	1.01
C	制造业	149,871,244.30	9.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,547,984.39	0.47
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	279,580.90	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	5,333,320.00	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,460,807.29	0.59
J	金融业	42,212,407.26	2.62
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,908,486.40	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	39,030.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,212,748.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	238,083,827.39	14.80

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	5,800	11,928,860.00	0.74
2	002142	宁波银行	242,488	9,449,757.36	0.59
3	000975	银泰黄金	773,780	7,358,647.80	0.46
4	300750	宁德时代	13,600	7,273,280.00	0.45
5	600036	招商银行	113,900	6,172,241.00	0.38
6	000001	平安银行	258,200	5,840,484.00	0.36
7	002948	青岛银行	1,162,000	5,775,140.00	0.36
8	688111	金山办公	14,496	5,723,020.80	0.36
9	300760	迈瑞医疗	11,900	5,712,595.00	0.35
10	605499	东鹏饮料	22,732	5,701,185.60	0.35
11	002568	百润股份	58,100	5,507,299.00	0.34
12	002928	华夏航空	353,200	5,333,320.00	0.33
13	300059	东方财富	149,220	4,892,923.80	0.30
14	002597	金禾实业	140,200	4,864,940.00	0.30
15	300357	我武生物	71,600	4,590,992.00	0.29
16	601877	正泰电器	136,400	4,553,032.00	0.28
17	600176	中国巨石	264,901	4,108,614.51	0.26
18	600549	厦门钨业	195,600	4,074,348.00	0.25
19	300122	智飞生物	21,800	4,070,714.00	0.25
20	600887	伊利股份	107,700	3,966,591.00	0.25
21	603259	药明康德	24,960	3,908,486.40	0.24
22	600346	恒力石化	146,100	3,833,664.00	0.24
23	600461	洪城环境	525,800	3,817,308.00	0.24
24	601995	中金公司	60,900	3,745,350.00	0.23
25	600483	福能股份	354,400	3,717,656.00	0.23
26	600570	恒生电子	39,500	3,683,375.00	0.23
27	002511	中顺洁柔	133,500	3,677,925.00	0.23
28	600309	万华化学	33,300	3,623,706.00	0.23
29	600567	山鹰国际	1,026,500	3,541,425.00	0.22
30	600111	北方稀土	170,300	3,525,210.00	0.22
31	600690	海尔智家	135,800	3,518,578.00	0.22
32	002791	坚朗五金	17,900	3,473,495.00	0.22
33	002258	利尔化学	133,600	3,446,880.00	0.21
34	002444	巨星科技	97,100	3,309,168.00	0.21
35	601899	紫金矿业	337,900	3,274,251.00	0.20
36	000333	美的集团	45,100	3,218,787.00	0.20
37	000516	国际医学	170,800	3,212,748.00	0.20
38	002459	晶澳科技	65,500	3,209,500.00	0.20
39	688526	科前生物	86,188	3,121,729.36	0.19
40	603993	洛阳钼业	602,100	3,106,836.00	0.19
41	002241	歌尔股份	71,900	3,073,006.00	0.19

42	603008	喜临门	91,700	3,027,017.00	0.19
43	603799	华友钴业	25,900	2,957,780.00	0.18
44	601169	北京银行	594,900	2,897,163.00	0.18
45	601633	长城汽车	63,300	2,759,247.00	0.17
46	603733	仙鹤股份	67,000	2,546,000.00	0.16
47	002984	森麒麟	69,000	2,515,050.00	0.16
48	000983	山西焦煤	295,200	2,453,112.00	0.15
49	000063	中兴通讯	70,300	2,336,069.00	0.15
50	600741	华域汽车	88,900	2,335,403.00	0.15
51	600809	山西汾酒	5,200	2,329,600.00	0.14
52	000625	长安汽车	86,200	2,265,336.00	0.14
53	603348	文灿股份	63,600	2,226,000.00	0.14
54	600060	海信视像	112,200	1,896,180.00	0.12
55	000830	鲁西化工	100,200	1,876,746.00	0.12
56	601166	兴业银行	87,300	1,794,015.00	0.11
57	002460	赣锋锂业	14,500	1,755,805.00	0.11
58	300618	寒锐钴业	21,000	1,655,640.00	0.10
59	601009	南京银行	153,100	1,610,612.00	0.10
60	600585	海螺水泥	39,100	1,605,055.00	0.10
61	000672	上峰水泥	91,100	1,592,428.00	0.10
62	603730	岱美股份	83,181	1,515,557.82	0.09
63	688383	新益昌	2,701	286,954.24	0.02
64	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.02
65	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.02
66	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.01
67	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.01
68	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
69	688669	聚石化学	2,681	86,837.59	0.01
70	300979	华利集团	805	70,437.50	0.00
71	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
72	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
73	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
74	300981	中红医疗	502	45,375.78	0.00
75	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
76	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
77	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.00
78	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
79	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
80	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
81	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
82	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
83	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
84	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00

85	300996	普联软件	310	14,068.34	0.00
86	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
87	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
88	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
89	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
90	300966	共同药业	358	12,311.56	0.00
91	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
92	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
93	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
94	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
95	300962	中金辐照	657	11,373.12	0.00
96	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
97	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
98	301011	华立科技	250	9,424.50	0.00
99	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
100	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
101	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
102	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
103	300987	川网传媒	304	8,186.69	0.00
104	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
105	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
106	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
107	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
108	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
109	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
110	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
111	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
112	301010	晶雪节能	272	5,127.96	0.00
113	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
114	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
115	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
116	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
117	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
118	300992	泰福泵业	200	4,064.00	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	000975	银泰黄金	7,679,205.80	1.30
2	000001	平安银行	6,946,627.36	1.17
3	002948	青岛银行	5,986,071.00	1.01
4	600519	贵州茅台	5,860,020.00	0.99
5	003816	中国广核	5,834,744.00	0.99
6	605499	东鹏饮料	5,390,084.13	0.91
7	600111	北方稀土	5,379,776.00	0.91
8	002568	百润股份	5,152,378.80	0.87
9	300760	迈瑞医疗	4,980,347.00	0.84
10	300357	我武生物	4,791,543.00	0.81
11	002142	宁波银行	4,726,345.00	0.80
12	601995	中金公司	4,058,556.00	0.69
13	600176	中国巨石	3,915,692.99	0.66
14	600036	招商银行	3,902,659.00	0.66
15	600461	洪城环境	3,829,852.03	0.65
16	002597	金禾实业	3,822,412.00	0.65
17	600549	厦门钨业	3,772,900.00	0.64
18	600570	恒生电子	3,704,973.00	0.63
19	600741	华域汽车	3,703,544.00	0.63
20	600483	福能股份	3,644,925.00	0.62

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	003816	中国广核	5,882,589.00	0.99
2	002142	宁波银行	3,032,059.99	0.51
3	300496	中科创达	2,901,483.00	0.49
4	688608	恒玄科技	2,892,650.55	0.49
5	600176	中国巨石	2,870,002.00	0.49
6	601928	凤凰传媒	2,769,184.00	0.47
7	600048	保利地产	2,756,354.00	0.47
8	300777	中简科技	2,605,848.25	0.44
9	000858	五粮液	2,568,013.00	0.43
10	603899	晨光文具	2,542,653.00	0.43
11	300595	欧普康视	2,329,457.00	0.39
12	603056	德邦股份	2,277,534.00	0.39
13	002511	中顺洁柔	2,247,303.00	0.38
14	603368	柳药股份	2,229,013.44	0.38

15	300433	蓝思科技	2,134,536.00	0.36
16	000066	中国长城	2,130,706.00	0.36
17	601799	星宇股份	2,075,783.00	0.35
18	600362	江西铜业	2,066,613.00	0.35
19	300618	寒锐钴业	2,028,130.20	0.34
20	002352	顺丰控股	1,990,855.00	0.34

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	241,509,800.81
卖出股票收入（成交）总额	170,068,171.52

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	29,064,400.00	1.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	180,664,000.00	11.23
	其中：政策性金融债	60,172,000.00	3.74
4	企业债券	482,325,275.70	29.97
5	企业短期融资券	20,004,000.00	1.24
6	中期票据	360,946,000.00	22.43
7	可转债（可交换债）	553,343.84	0.03
8	同业存单	29,154,000.00	1.81
9	其他	-	-
10	合计	1,102,711,019.54	68.53

#### 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	143616	18 浙能 01	300,000	30,882,000.00	1.92
2	102001786	20 国盛 MTN002	300,000	30,477,000.00	1.89
3	149001	19 广核 01	300,000	30,177,000.00	1.88
4	102000238	20 南航股 MTN003	300,000	29,970,000.00	1.86
5	163244	20 中证 G3	300,000	29,919,000.00	1.86

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 7.11.3 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除 21 招商银行 CD076（证券代码 112107076）外其他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。

2021 年 5 月 21 日公告称，为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等原因，中国银行保险监督管理委员会对公司罚款 7170 万元。

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	130,366.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,379,999.52
5	应收申购款	5,861,594.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,371,960.64

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方利淘	32,826	29,335.10	68,286,474.	7.09%	894,667,38	92.91%



A 类			64		9.44	
南方利淘 C 类	16,138	3,799.96	45,672,497.65	74.48%	15,651,303.09	25.52%
合计	48,964	20,918.99	113,958,972.29	11.13%	910,318,692.53	88.87%

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

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方利淘 A 类	7,582,896.47	0.7875%
	南方利淘 C 类	62,194.40	0.1014%
	合计	7,645,090.87	0.7464%

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

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方利淘 A 类	0
	南方利淘 C 类	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方利淘 A 类	0~10
	南方利淘 C 类	0~10
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方利淘 A 类	南方利淘 C 类
基金合同生效日(2015 年 4 月 17 日)基金份额总额	6,824,828,709.02	-
本报告期期初基金份额总额	384,495,377.96	6,433,766.69
本报告期基金总申购份额	910,967,236.71	60,546,546.57
减：报告期基金总赎回份额	332,508,750.59	5,656,512.52
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	962,953,864.08	61,323,800.74

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长病逝缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

2021 年 5 月 19 日，公司副总经理常克川兼任首席信息官。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			额的比例			
中信证券	2	404,996,647.02	100.00%	369,080.74	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。

### 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
中信证券	433,550,236.80	100.00%	11,595,100,000.00	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	南方基金关于旗下部分基金增加部分销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-14
2	南方基金关于旗下部分基金增加招商银行招赢通为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-15

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公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-25
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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-04
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公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-23
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公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-02
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公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-08
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公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-16
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-19
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公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
11	南方基金关于旗下部分基金增加东方财富证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-26
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公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-29
13	南方基金管理股份有限公司关于中信建投期货有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
14	南方利淘灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、定投和转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-07
15	南方基金关于旗下部分基金参加中国银行固收及“固收+”系列公募基金申购优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-08
16	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金申购费率优惠标准的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-08
17	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会	2021-04-13

		会基金电子披露网站	
18	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方兴业证券承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
19	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方华泰联合证券承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
20	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-19
21	南方基金关于旗下部分基金增加交通银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-22
22	南方基金关于旗下部分基金增加宜信普泽为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-26
23	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-01
24	南方基金关于旗下部分基金增加国金证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-07
25	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-13
26	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-15
27	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-21
28	南方基金管理股份有限公司关于北京加和基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-08
29	南方基金关于旗下部分基金增加广发银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-11
30	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-11
31	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公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-18
32	南方基金管理股份有限公司关于大河财富基金	中国证券报、基金管	2021-06-18

	销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
33	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-25

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20210603	296,979,482.73	-	296,979,482.73	-	-

#### 产品特有风险

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

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方利淘灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方利淘灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方利淘灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方利淘灵活配置混合型证券投资基金 2021 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>