

# 南方均衡回报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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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 4 月 27 日（基金合同生效日）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.....	7
§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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	12
§5 托管人报告.....	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.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	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.....	41
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.....	44
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45

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 .....	47
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 .....	48
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	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 .....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
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 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
§12 备查文件目录 .....	52
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方均衡回报混合型证券投资基金	
基金简称	南方均衡回报混合	
基金主代码	011698	
交易代码	011698	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 4 月 27 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,203,562,651.06 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方均衡回报混合 A	南方均衡回报混合 C
下属分级基金的交易代码	011698	011701
报告期末下属分级基金的份 额总额	1,121,282,903.21 份	82,279,747.85 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“南方均衡回报混合”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	南方基金管理股份有限公司	交通银行股份有限公司
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	95559
传真	0755-82763889	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518017	200336
法定代表人	杨小松（代为履行法定代表人职责）	任德奇

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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

## 2.5 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、南方均衡回报混合 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年4月27日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	4,049,350.91
本期利润	9,605,846.93
加权平均基金份额本期利润	0.0086
本期加权平均净值利润率	0.85%
本期基金份额净值增长率	0.86%
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	4,049,350.91
期末可供分配基金份额利润	0.0036
期末基金资产净值	1,130,888,750.14
期末基金份额净值	1.0086
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	0.86%

## 2、南方均衡回报混合 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年4月27日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	239,179.33
本期利润	646,702.02
加权平均基金份额本期利润	0.0079
本期加权平均净值利润率	0.78%
本期基金份额净值增长率	0.79%
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	239,179.33
期末可供分配基金份额利润	0.0029
期末基金资产净值	82,926,449.87
期末基金份额净值	1.0079
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	0.79%

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、本基金合同生效日为 2021 年 4 月 27 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满半年。

### 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

南方均衡回报混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.36%	0.15%	-0.78%	0.38%	1.14%	-0.23%
自基金合同生效起至今	0.86%	0.11%	1.29%	0.44%	-0.43%	-0.33%

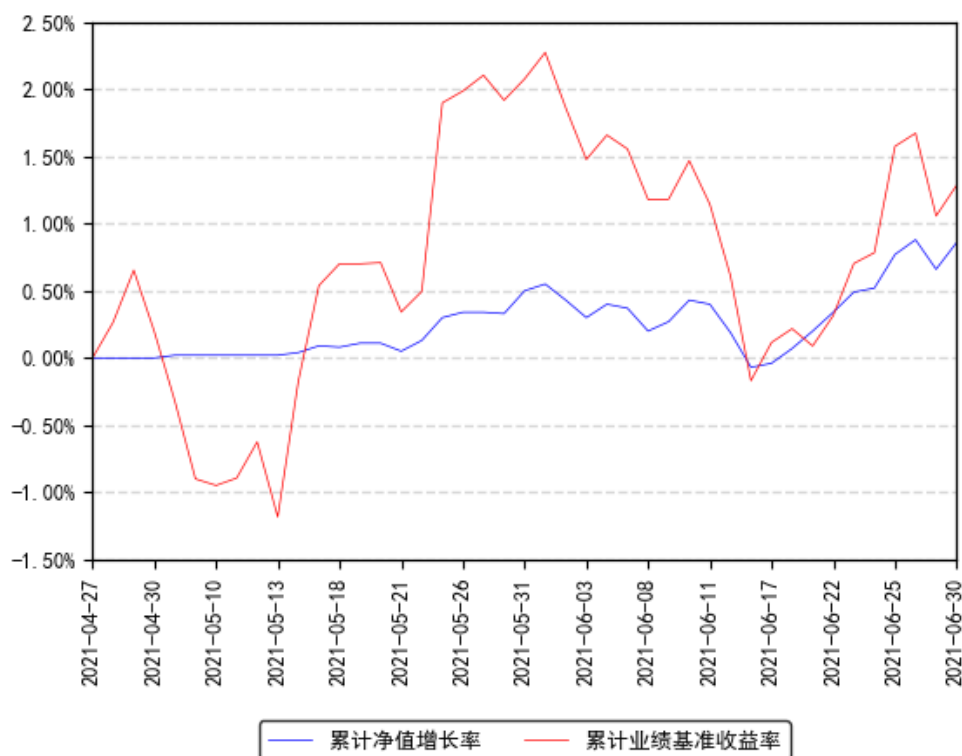
南方均衡回报混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.33%	0.15%	-0.78%	0.38%	1.11%	-0.23%
自基金合同生效起至今	0.79%	0.11%	1.29%	0.44%	-0.50%	-0.33%

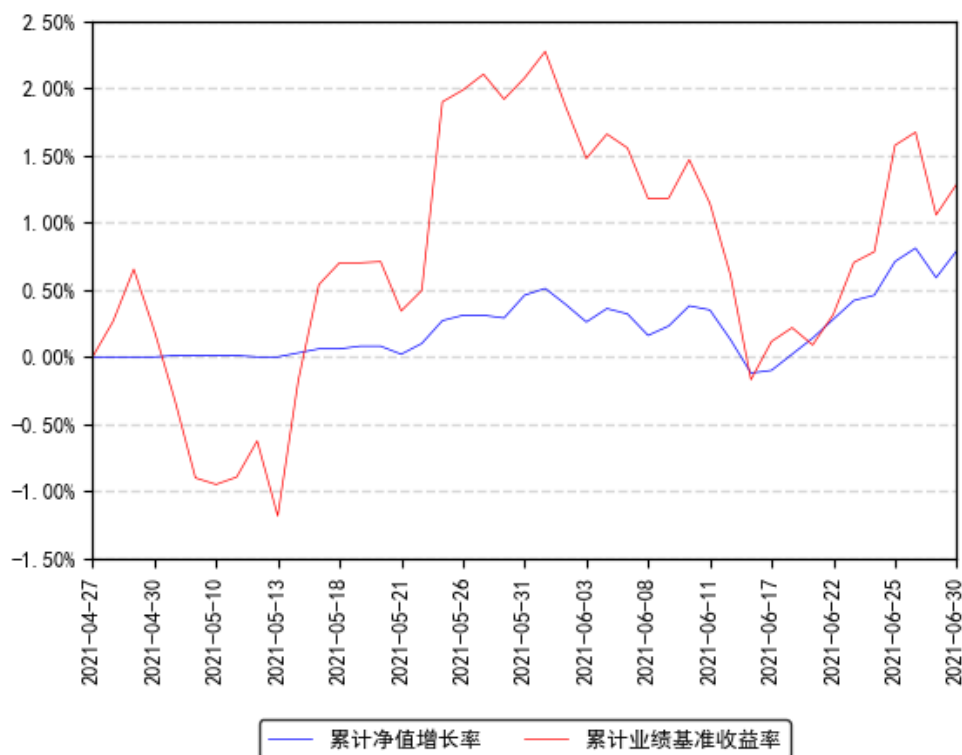
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



南方均衡回报混合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



南方均衡回报混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于2021年4月27日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起6个月内为建仓期，截至报告期末基金尚未完成建仓。

## § 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		
林乐峰	本基金基金经理	2021 年 4 月 27 日	-	12 年	北京大学理学硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金研究部，历任研究员、高级研究员，负责钢铁、机械制造、中小市值的行业研究。2015 年 2 月 26 日至 2016 年 3 月 30 日，任南方高增长基金经理助理；2017 年 12 月 15 日至 2019 年 7 月 5 日，任南方甄智混合基金经理；2019 年 7 月 5 日至 2020 年 12 月 11 日，任南方甄智混合基金经理；2019 年 1 月 25 日至 2021 年 1 月 22 日，任南方安睿混合基金经理；2016 年 3 月 30 日至今，任南方宝元基金经理；2017 年 8 月 18 日至今，任南方安康混合基金经

					理；2017 年 12 月 15 日至今，任南方转型混合基金经理；2019 年 1 月 25 日至今，任南方安裕混合基金经理；2019 年 3 月 15 日至今，任南方盛元基金经理；2019 年 12 月 27 日至今，任南方宝泰一年混合基金经理；2020 年 3 月 5 日至今，任南方宝丰混合基金经理；2021 年 4 月 27 日至今，任南方均衡回报混合基金经理。
--	--	--	--	--	---

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，国内各项经济数据多数继续向好，PMI 持续位于荣枯线以上，出口、制造业投资等领域都继续呈现向上趋势，但社会融资规模增速有所回落，市场对于经济复苏的持续性产生分歧，流动性则持续在偏宽松的水平。外部方面，随着疫苗接种率的提升，海外疫情有望得到控制，全球即将进入经济复苏通道，同时市场也对美联储退出量化宽松的进程有所关注。综合各种因素影响，上半年 A 股市场经历了大幅波动，上证指数上涨 3.40%，沪深 300 指数上涨 0.24%，创业板指大幅上涨 17.22%。所有 30 个行业指数中有 20 个实现上涨，其中基础化工、钢铁、电力设备及新能源涨幅居前，下跌较多的行业是非银行金融、家电、国防军工。

本基金成立于 4 月 27 日，二季度处于建仓期。由于今年 A 股市场波动性较大，从控制风险的角度，我们希望在运作初期避免净值大幅波动，循序渐进稳步建仓。

权益投资方面，我们对长期稳定增长的消费品、有竞争力的先进制造进行了一定的配置。此外我们也配置了一些低估值价值股以期获得平稳的绝对收益，这类品种对新基金的建仓有所帮助。固定收益投资方面，本基金平稳建仓，以持有到期获取稳健收益为目的，信用债整体评级较高，久期和杠杆率控制在合适的水平。

#### 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 1.0086 元，报告期内，份额净值增长率为 0.86%，同期业绩基准增长率为 1.29%；本基金 C 份额净值为 1.0079 元，报告期内，份额净值增长率为 0.79%，同期业绩基准增长率为 1.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，我们认为中国经济仍然处在复苏中，只是复苏强度弱于上半年，对应地同比数据会有下行趋势，但整体经济结构仍比较健康。出口和制造业投资仍然保持不错的趋势，消费虽未恢复到疫情前的增速水平，但可以预期明年增速有望改善。政策层面当前仍处在宽松状态，预计未来会根据经济和通胀的变化适当微调，美国退出宽松的节奏也有待观察。

对于资本市场，A 股上半年表现分化较大。从整体估值来看，沪深 300 市盈率还处在合理偏低的位置，价值股的折价幅度也处在历史高点，银行、公用事业等基本面扎实的价值股值得作为绝对收益投资。此外，消费相关板块仍然是长期看得清楚的好赛道，回调到合理位置的好公司适合长期持有。作为中国有优势的制造业领域，一些具备全球竞争力的先进制造类公司，也会是我们重点布局的方向之一。

#### 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

根据本基金基金合同约定，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，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，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为同一类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，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供分配利润将有所不同。本基金同一类别的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

报告期内，托管人在南方均衡回报混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

## 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

报告期内，南方基金管理股份有限公司在南方均衡回报混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

## 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

报告期内，由南方基金管理股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关南方均衡回报混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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：南方均衡回报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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	23,417,608.82
结算备付金		80,084,179.37
存出保证金		62,498.43
交易性金融资产	6.4.7.2	873,530,140.83
其中：股票投资		295,321,521.53
基金投资		-
债券投资		578,208,619.30
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-

衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	252,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	4,801,233.77
应收股利		16,000.00
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,233,911,661.22
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		18,570,323.72
应付赎回款		-
应付管理人报酬		993,009.90
应付托管费		198,601.99
应付销售服务费		27,140.80
应付交易费用	6.4.7.7	266,078.91
应交税费		28,253.89
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	13,052.00
负债合计		20,096,461.21
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	1,203,562,651.06
未分配利润	6.4.7.10	10,252,548.95
所有者权益合计		1,213,815,200.01
负债和所有者权益总计		1,233,911,661.22

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，南方均衡回报混合 A 份额净值 1.0086 元，基金份额总额 1,121,282,903.21 份；南方均衡回报混合 C 份额净值 1.0079 元，基金份额总额 82,279,747.85 份；总份额合计 1,203,562,651.06 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方均衡回报混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		13,179,368.69
1. 利息收入		4,332,128.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	216,738.16
债券利息收入		1,365,519.65
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,749,870.93
其他利息收入		-
证券出借利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,883,164.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	817,171.38
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	2,065,992.97
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	5,964,018.71



4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 19	56. 89
减：二、费用		2, 926, 819. 74
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	2, 115, 113. 35
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	423, 022. 69
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	57, 820. 00
4. 交易费用	6. 4. 7. 20	311, 376. 74
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		3, 599. 96
7. 其他费用	6. 4. 7. 21	15, 887. 00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10, 252, 548. 95
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10, 252, 548. 95

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方均衡回报混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）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）	1, 203, 562, 651. 06	-	1, 203, 562, 651. 06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10, 252, 548. 95	10, 252, 548. 95
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）			
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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, 203, 562, 651. 06	10, 252, 548. 95	1, 213, 815, 200. 01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

南方均衡回报混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]第 499 号《关于准予南方均衡回报混合型证券投资基金注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方均衡回报混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金根据是否收取销售服务费,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,202,936,976.57 元,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(21)第 00194 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方均衡回报混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 4 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,203,562,651.06 份,其中认购资金利息折合 625,674.49 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方均衡回报混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票以及存托凭证(下同))、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(简称“港股通股票”)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、

公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、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)、同业存单、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为:本基金股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例范围为 30%-60%(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、国债期货、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。

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 40%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 10%+上证国债指数收益率 $\times$ 50%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项,暂无金融资产

划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

#### 2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种, 如估值日有市价的, 采用市价确定公允价值; 估值日无市价, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的, 采用最近交易市价确定公允价值; 对于发行时明确一定期限限售期的股票, 包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等, 按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种, 如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时, 应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素, 调整最近交易市价, 确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场, 基金管理人估值委员会认为必要时, 采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术, 确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时, 尽可能最大程度使用市场参数, 减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利, 且目前可执行该种法定权利, 同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时, 金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外, 金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示, 不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时, 相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例, 损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

## 2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后净额确认。

## 3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2) 基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为同一类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3) 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；

4) 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供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在与基金托管人协商一致，并按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日在规定媒介公告。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意

见》(中国证监会公告[2017]13 号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13 号)相关规定,本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24 号),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 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。

## 6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018 年 1 月 1 日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。



(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	23,417,608.82
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	23,417,608.82

### 6.4.7.2 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	288,724,169.02	295,321,521.53	6,597,352.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	268,576,619.30	-637,125.98
	银行间市场	309,632,000.00	3,792.18

	合计	578,841,953.10	578,208,619.30	-633,333.80
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		867,566,122.12	873,530,140.83	5,964,018.71

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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	252,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	252,000,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 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	2,109.42
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	34,895.54
应收债券利息	4,707,935.24
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	56,257.40
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	36.17
合计	4,801,233.77

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 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	263,053.91
银行间市场应付交易费用	3,025.00
合计	266,078.91

#### 6.4.7.8 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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	13,052.00
合计	13,052.00

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

南方均衡回报混合 A		
项目	本期 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,121,282,903.21	1,121,282,903.21
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,121,282,903.21	1,121,282,903.21

南方均衡回报混合 C		
项目	本期 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	82,279,747.85	82,279,747.85
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	82,279,747.85	82,279,747.85

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。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

南方均衡回报混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,049,350.91	5,556,496.02	9,605,846.93
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,049,350.91	5,556,496.02	9,605,846.93

南方均衡回报混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	239,179.33	407,522.69	646,702.02
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	239,179.33	407,522.69	646,702.02

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	105,976.25
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	110,683.90
其他	78.01
合计	216,738.16

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,068,380.74
减：卖出股票成本总额	251,209.36
买卖股票差价收入	817,171.38

**6.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

**6.4.7.14 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。

**6.4.7.15 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。

**6.4.7.16 衍生工具收益****6.4.7.16.1 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。

**6.4.7.16.2 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。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日） 至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,065,992.97
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	2,065,992.97

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	5,964,018.71
——股票投资	6,597,352.51
——债券投资	-633,333.80
——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	5,964,018.71
----	--------------

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日） 至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
其他	56.89
合计	56.89

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	308,351.74
银行间市场交易费用	3,025.00
合计	311,376.74

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	13,052.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	2,435.00
其他	400.00
合计	15,887.00

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
兴业证券	42,558,319.97	14.70%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
兴业证券	38,782.29	14.74%	38,782.29	14.74%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,115,113.35
其中：支付销售机构的客户维护费	936,964.16

注：支付基金管理人南方基金管理股份有限公司的基金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：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%÷当年天数

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	423,022.69

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.2%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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数

#### 6.4.10.2.3 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 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方均衡回报混合 A	南方均衡回报混合 C	合计
华泰证券	-	2,309.46	2,309.46
交通银行	-	932.93	932.93
南方基金	-	14,918.31	14,918.31
兴业证券	-	15.60	15.60
合计	-	18,176.30	18,176.30

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 0.40% 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 X 0.40%/ 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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



**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	23,417,608.82	105,976.25

注：本基金由基金托管人交通银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

单位：人民币元

本期 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）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	9,990	999,000.00
华泰联合证券	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18

**6.4.10.8 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。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2021 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

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
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	-
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	-

## 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
127037	银轮转债	2021年 6月7 日	2021年 7月9 日	配债未 上市	100.0 0	100.0 0	2,651	265,100.00	265,100.00	-
113050	南银转债	2021年 6月16 日	2021年 7月1 日	配债未 上市	100.0 0	100.0 0	9,990	999,000.00	999,000.00	-

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、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。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

无。

#### **6.4.13 金融工具风险及管理**

本基金是混合型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临的各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。

本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险、外汇风险和市场价格风险。

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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、债券投资和资产支持证券投资等。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人交通银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款兑付交割方式，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。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在开放赎回日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。

本基金所持大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，因此，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为开放式基金，投资者可在合同规定的交易日进行基金申购与赎回业务，本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款和债券投资。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 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	23,417,608.8 2	-	-	-	23,417,608.8 2
结算备付金	80,084,179.3 7	-	-	-	80,084,179.3 7

存出保证金	62,498.43	-	-	-	62,498.43
交易性金融资产	110,923,519.30	466,021,000.00	1,264,100.00	295,321,521.53	873,530,140.83
买入返售金融资产	252,000,000.00	-	-	-	252,000,000.00
应收利息	-	-	-	4,801,233.77	4,801,233.77
应收股利	-	-	-	16,000.00	16,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	466,487,805.92	466,021,000.00	1,264,100.00	300,138,755.30	1,233,911,661.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	993,009.90	993,009.90
应付托管费	-	-	-	198,601.99	198,601.99
应付证券清算款	-	-	-	18,570,323.72	18,570,323.72
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	27,140.80	27,140.80
应付交易费用	-	-	-	266,078.91	266,078.91
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	28,253.89	28,253.89
其他负债	-	-	-	13,052.00	13,052.00
负债总计	-	-	-	20,096,461.21	20,096,461.21
利率敏感度缺口	466,487,805.92	466,021,000.00	1,264,100.00	280,042,294.09	1,213,815,200.01

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年6月30日）

	1.市场利率平行上升 25 个基点	-2,988,858.69
	2.市场利率平行下降 25 个基点	3,014,923.28

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	14,682,883.68	-	-	-	14,682,883.68
资产合计	-	14,682,883.68	-	-	-	14,682,883.68
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	-	14,682,883.68	-	-	-	14,682,883.68

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2021 年 6 月 30 日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	734,144.18
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-734,144.18

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。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债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	295,321,521.53	24.33
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	295,321,521.53	24.33

#### 6.4.13.4.3.2 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）
	1. 沪深 300 上升 5%	13,024,355.32
	2. 沪深 300 下降 5%	-13,024,355.32

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

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

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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，本基金分别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根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。



本基金银行间市场交易的固定收益品种、以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债除外)按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值,相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

(2) 除公允价值外,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	295,321,521.53	23.93
	其中:股票	295,321,521.53	23.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	578,208,619.30	46.86
	其中:债券	578,208,619.30	46.86
	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	252,000,000.00	20.42
	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	103,501,788.19	8.39
8	其他资产	4,879,732.20	0.40
9	合计	1,233,911,661.22	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 9,602,203.20 元,占基金资产净值比例 0.79%;通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 5,080,680.48 元,占基金资产净值比例 0.42%。

### 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	9,915,000.00	0.82
C	制造业	185,841,241.94	15.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,911,164.54	1.72
E	建筑业	11,014.44	0.00

F	批发和零售业	4,950,759.00	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,782,137.38	1.05
J	金融业	37,565,020.55	3.09
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,750,300.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,179,000.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,733,000.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	280,638,637.85	23.12

### 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	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费	-	-
必需消费品	3,478,094.40	0.29
医疗保健	-	-
金融	3,478,094.40	0.29
科技	5,080,680.48	0.42
通讯	-	-
公用事业	2,646,014.40	0.22
房地产	-	-
政府	-	-
合计	14,682,883.68	1.21

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	700,001	14,385,020.55	1.19
2	600886	国投电力	1,100,015	10,571,144.15	0.87
3	601877	正泰电器	300,000	10,014,000.00	0.83
4	600887	伊利股份	250,000	9,207,500.00	0.76
5	601288	农业银行	3,000,000	9,090,000.00	0.75

6	600741	华域汽车	300,000	7,881,000.00	0.65
7	600176	中国巨石	500,000	7,755,000.00	0.64
8	600060	海信视像	450,000	7,605,000.00	0.63
9	603806	福斯特	72,000	7,569,360.00	0.62
10	600066	宇通客车	600,000	7,494,000.00	0.62
11	000858	五粮液	25,000	7,447,250.00	0.61
12	002459	晶澳科技	150,000	7,350,000.00	0.61
13	000333	美的集团	100,000	7,137,000.00	0.59
14	600519	贵州茅台	3,000	6,170,100.00	0.51
15	002460	赣锋锂业	50,000	6,054,500.00	0.50
16	300601	康泰生物	40,000	5,960,000.00	0.49
17	002984	森麒麟	157,600	5,744,520.00	0.47
18	600872	中炬高新	130,046	5,464,532.92	0.45
19	601009	南京银行	500,000	5,260,000.00	0.43
20	600483	福能股份	500,000	5,245,000.00	0.43
21	600690	海尔智家	200,000	5,182,000.00	0.43
22	603993	洛阳钼业	1,000,000	5,160,000.00	0.43
23	600461	洪城环境	700,000	5,082,000.00	0.42
24	600723	首商股份	600,092	4,950,759.00	0.41
25	002212	天融信	250,000	4,942,500.00	0.41
26	000975	银泰黄金	500,000	4,755,000.00	0.39
27	603866	桃李面包	149,960	4,678,752.00	0.39
28	603799	华友钴业	40,014	4,569,598.80	0.38
29	600765	中航重机	200,000	4,530,000.00	0.37
30	002966	苏州银行	600,000	4,410,000.00	0.36
31	002439	启明星辰	150,098	4,354,342.98	0.36
32	300866	安克创新	25,000	4,186,750.00	0.34
33	002414	高德红外	150,000	4,137,000.00	0.34
34	002092	中泰化学	400,000	4,108,000.00	0.34
35	300618	寒锐钴业	50,000	3,942,000.00	0.32
36	600346	恒力石化	150,000	3,936,000.00	0.32
37	600057	厦门象屿	600,048	3,750,300.00	0.31
38	002475	立讯精密	80,000	3,680,000.00	0.30
39	688526	科前生物	100,000	3,622,000.00	0.30
40	00168	青岛啤酒股份	50,000	3,478,094.40	0.29
41	03908	中金公司	200,000	3,478,094.40	0.29
42	688023	安恒信息	13,782	3,473,064.00	0.29
43	002241	歌尔股份	80,000	3,419,200.00	0.28
44	603589	口子窖	50,000	3,384,500.00	0.28
45	600309	万华化学	30,000	3,264,600.00	0.27
46	000895	双汇发展	100,000	3,180,000.00	0.26
47	002472	双环传动	200,000	3,140,000.00	0.26

48	002126	银轮股份	300,000	3,120,000.00	0.26
49	600862	中航高科	100,000	3,078,000.00	0.25
50	02382	舜宇光学科 技	15,000	3,062,886.48	0.25
51	300696	爱乐达	70,090	2,917,145.80	0.24
52	002044	美年健康	300,000	2,733,000.00	0.23
53	00836	华润电力	300,000	2,646,014.40	0.22
54	601169	北京银行	500,000	2,435,000.00	0.20
55	300470	中密控股	60,000	2,318,400.00	0.19
56	600323	瀚蓝环境	100,000	2,179,000.00	0.18
57	00763	中兴通讯	100,000	2,017,794.00	0.17
58	601916	浙商银行	500,000	1,985,000.00	0.16
59	002985	北摩高科	20,000	1,950,000.00	0.16
60	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.03
61	605499	东鹏饮料	600	150,480.00	0.01
62	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
63	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
64	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
65	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
66	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
67	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
68	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
69	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
70	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
71	605259	绿田机械	95	3,386.75	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末基金资产净值 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	占期末基金资产 净值比例（%）
1	601166	兴业银行	14,733,700.54	1.21
2	600886	国投电力	10,726,936.75	0.88
3	600887	伊利股份	9,669,709.00	0.80
4	601288	农业银行	9,645,000.00	0.79
5	601877	正泰电器	9,237,061.00	0.76
6	000333	美的集团	8,079,722.00	0.67
7	600066	宇通客车	7,813,884.73	0.64
8	000858	五粮液	7,445,296.00	0.61

9	600741	华域汽车	7,401,776.00	0.61
10	600176	中国巨石	7,291,604.14	0.60
11	300601	康泰生物	6,849,236.61	0.56
12	600519	贵州茅台	6,100,538.00	0.50
13	600872	中炬高新	6,042,185.82	0.50
14	002460	赣锋锂业	5,791,708.00	0.48
15	002984	森麒麟	5,690,482.00	0.47
16	603806	福斯特	5,398,954.95	0.44
17	603993	洛阳钼业	5,320,976.00	0.44
18	600060	海信视像	5,281,095.00	0.44
19	600461	洪城环境	5,272,450.08	0.43
20	600723	首商股份	5,265,298.04	0.43

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	688690	纳微科技	372,982.30	0.03
2	688276	百克生物	368,957.32	0.03
3	688601	力芯微	197,480.02	0.02
4	603529	爱玛科技	75,706.00	0.01
5	688367	工大高科	45,157.10	0.00
6	605259	绿田机械	8,098.00	0.00

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	288,975,378.38
卖出股票收入（成交）总额	1,068,380.74

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,731,519.30	0.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,779,000.00	6.65

	其中：政策性金融债	60,597,000.00	4.99
4	企业债券	245,399,000.00	20.22
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	200,440,000.00	16.51
7	可转债（可交换债）	1,264,100.00	0.10
8	同业存单	48,595,000.00	4.00
9	其他	-	-
10	合计	578,208,619.30	47.64

## 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	112103068	21 农业银行 CD068	500,000	48,595,000.00	4.00
2	150412	15 农发 12	300,000	30,417,000.00	2.51
3	190207	19 国开 07	300,000	30,180,000.00	2.49
4	143616	18 浙能 01	200,000	20,588,000.00	1.70
5	102100437	21 人才安居 MTN001	200,000	20,208,000.00	1.66

## 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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本，以达到降低投资组合整体风险的目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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 19 国开 07（证券代码 190207）、21 农业银行 CD068（证券代码 112103068）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。

#### 1、19 国开 07（证券代码 190207）

根据中国银保监会公告，2020 年 12 月 25 日，因国家开发银行存在“为违规的政府购买服务项目提供融资”等 24 项违规情形，中国银保监会决定对其处罚款 4880 万元。

#### 2、21 农业银行 CD068（证券代码 112103068）

处罚时间：2020 年 7 月 13 日 处罚依据：（一）向关系人发放信用贷款（二）批量处置不良资产未公告（三）批量处置不良资产未向监管部门报告等 处罚结果：罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 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	62,498.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	16,000.00
4	应收利息	4,801,233.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,879,732.20

### 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
南方均衡回报混合 A	11,989	93,525.97	10,405,314.74	0.93%	1,110,877,588.47	99.07%
南方均衡回报混合 C	9,575	8,593.19	-	-	82,279,747.85	100.00%
合计	21,564	55,813.52	10,405,314.74	0.86%	1,193,157,336.32	99.14%

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	南方均衡回报混合 A	915,884.42	0.0817%
	南方均衡回报混合 C	21,074.70	0.0256%
	合计	936,959.12	0.0778%

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	南方均衡回报混合 A	10~50
	南方均衡回报混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	南方均衡回报混合 A	0
	南方均衡回报混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方均衡回报混合 A	南方均衡回报混合 C
基金合同生效日(2021 年 4 月 27 日)基金份额总额	1,121,282,903.21	82,279,747.85
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,121,282,903.21	82,279,747.85

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

### 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	
中金财富	1	68,560,825.27	23.68%	62,476.27	23.75%	-
国盛证券	1	67,856,067.75	23.44%	61,381.04	23.33%	-
中信证券	1	55,713,945.79	19.24%	50,772.80	19.30%	-
长江证券	1	43,796,704.71	15.13%	39,599.67	15.05%	-
兴业证券	2	42,558,319.97	14.70%	38,782.29	14.74%	-
国泰君安	1	4,765,219.00	1.65%	4,342.69	1.65%	-
国信证券	1	3,593,290.20	1.24%	3,276.06	1.25%	-
申万宏源	2	2,659,112.00	0.92%	2,423.09	0.92%	-
天风证券	2	-	-	-	-	-

广发证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

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

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

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

### 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
中金财富	-	-	4,724,000,000.00	24.73%	-	-
国盛证券	41,607,707.60	18.30%	1,858,000,000.00	9.73%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	80,325,500.00	35.33%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	5,513,000,000.00	28.86%	-	-
国泰君安	10,097,300.00	4.44%	-	-	-	-

国信证券	-	-	770,000,000.00	4.03%	-	-
申万宏源	95,354,350.00	41.94%	2,000,000,000.00	10.47%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	4,240,000,000.00	22.19%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方均衡回报混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-29
2	南方基金关于旗下电子直销平台部分基金相关调整的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
3	南方基金关于南方均衡回报混合型证券投资基金增加销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-06
4	南方基金关于南方均衡回报混合型证券投资基金增加销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-07
5	南方基金关于南方均衡回报混合型证券投资基金增加销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-12
6	南方基金关于南方均衡回报混合型证券投资基金增加销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-15
7	南方基金关于南方均衡回报混合型证券投资基金增加销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-19
8	关于南方均衡回报混合型证券投资基金基金份额发售时间的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-20
9	南方基金关于南方均衡回报混合型证券投资基金增加销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-21
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可转换公司债券的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会	2021-06-18

		会基金电子披露网站	
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	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

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均衡回报混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方均衡回报混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方均衡回报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、《南方均衡回报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>