

南方全球精选配置证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9 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遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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.....	18
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	38
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....	38
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	46
7.8 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

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	46
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	46
7.11 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末上市基金前十名持有人	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.4 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	49
§9 开放式基金份额变动	49
§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	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方全球精选配置证券投资基金
基金简称	南方全球精选配置(QDII-FOF)
基金主代码	202801
交易代码	202801
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 9 月 19 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,094,618,821.32 份
基金合同存续期	不定期

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“南方全球”。

2.2 基金产品说明

投资目标	通过基金全球化的资产配置和组合管理，实现组合资产的分散化投资，在降低组合波动性的同时，实现基金资产的最大增值。
投资策略	本基金在基金资产的配置上采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的配置策略，在有效分散风险的基础上，提高基金资产的收益。1、战略性资产配置策略（Strategic Asset Allocation）在宏观经济与地区经济分析、掌握全球经济趋势的基础上，通过量化分析，确定资产种类(Asset Class)与权重，并定期进行回顾和动态调整。2、战术性资产配置策略（Tactical Asset Allocation）在成熟市场和新兴市场中根据不同国家和地区经济发展及证券市场的发展变化对资产进行国家及区域配置，在不同国家的配置比例上采用“全球资产配置量化”模型进行配置和调整。由于短期市场会受到一些非理性或者非基本面因素的影响而产生波动，基金经理将根据对不同因素的研究与判断，对基金投资组合进行调整，以降低投资组合的投资风险。本基金的大部分资产将投资于 ETF 基金、股票型基金和在香港市场投资于公开发行的、上市的股票。利用定量和定性的方式筛选基金，在香港市场的选股策略的主要标准：市场及行业地位（market position）、估值（intrinsic value）、盈利预期（earning surprise）、和良好的趋势（investment trend）。
业绩比较基准	60%×MSCI 世界指数（MSCI World Index）+40%×MSCI 新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index）。
风险收益特征	本基金为基金中基金，属于中等偏高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和收益水平低于全球股票型基金、高于债券基金及货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	010-66105798
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518017	100140
法定代表人	杨小松（代为履行法定代表人职责）	陈四清

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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外资产托管人	
名称	中文	纽约梅隆银行股份有限公司
	英文	The Bank of New York Mellon Corporation
注册地址	225 Liberty St, New York, New York 10286 USA	
办公地址	225 Liberty St, New York, New York 10286 USA	
邮政编码	10286	

2.5 信息披露方式

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

2.6 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

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	311,174,110.44
本期利润	205,456,891.90
加权平均基金份额本期利润	0.0936
本期加权平均净值利润率	7.55%
本期基金份额净值增长率	7.55%
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	388,510,916.95
期末可供分配基金份额利润	0.1855
期末基金资产净值	2,651,240,138.48
期末基金份额净值	1.266
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	34.53%

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。

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.36%	0.46%	2.25%	0.42%	-0.89%	0.04%
过去三个月	3.69%	0.55%	4.39%	0.56%	-0.70%	-0.01%
过去六个	7.55%	0.78%	8.88%	0.76%	-1.33%	0.02%

月						
过去一年	19.88%	0.83%	25.73%	0.81%	-5.85%	0.02%
过去三年	46.07%	0.99%	35.73%	1.12%	10.34%	-0.13%
自基金合同生效起至今	34.53%	1.09%	73.31%	1.16%	-38.78%	-0.07%

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

南方全球精选配置(QDII-FOF)累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日,经中国证监会批准,南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立,成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018年1月,公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019年7月,根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议,并经中国证监会核准,本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本,认购完成后注册资本为36172万元人民币。目前股权结构为: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		
黄亮	本基金基金经理	2009年6月25日	-	20年	北京大学工商管理硕士, 具有基金从业资格。曾任职于招商证券股份有限公司、天华投资有限责任公司, 2005年加入南方基金国际业务部, 现任国际业务部总经理、国际投资决策委员会委员; 2011年9月26日至2015年5月13日, 任南方中国中小盘基金经理; 2015年5月13日至2017年11月9日, 任南方香港优选基金经理; 2017年4月26日至2019年4月22日, 任国企精明基金经理; 2010年12月9日至2020年9月18日, 任南方金砖基金经理; 2009年6月25日至今, 任南方全球基金经理; 2016年6月15日至今, 任南方原油基金经理; 2017年10月26日至今, 任美国REIT基金经理; 2019年4月3日至今, 任南方香港成长基金经理; 2020年12月25日至今, 任南方沪港深优势基金经理; 2021年4月2日至今, 兼任投资经理。

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

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
黄亮	公募基金	5	7,648,090,433.80	2009年6月25日
	私募资产管理计划	1	101,579,511.56	2021年4月8日

	其他组合	1	311,924,174.35	2021 年 2 月 5 日
	合计	7	8,061,594,119.71	-

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年全球尽管部分地区通报新增确诊出现回升迹象，但随着疫苗的普及，全球整体新增确诊进一步下降，停工停产以及社交隔离逐步减少，新冠疫情对于经济带来的短期扰动正在逐步消退。近期 Delta 病毒的爆发使得市场对于全球经济恢复进度再度产生担忧。与此同时，随着信贷政策的逐步正常化以及对于房地产行业的严格调控，中国整

体经济动能呈现从高位回落的趋势。根据 Bloomberg 的统计，2021 年 1 月至 2021 年 6 月发达市场 Markit 制造业月度 PMI 分别为 55.2、56.5、58.5、59.3、59.8 和 59.5，延续高景气，其中美国 Markit 制造业月度 PMI 分别为 59.2、58.6、59.1、60.5、62.1 和 62.1；新兴市场 Markit 制造业月度 PMI 分别为 52.1、51.5、51.3、52.2、52.0 和 51.3，保持在荣枯线以上但二季度呈现回落的趋势。从风格上来看，全球价值股指数小幅跑赢成长股指数。按美元计价全收益口径计算，2021 年上半年 MSCI 全球价值指数上涨 15.2%，MSCI 全球成长指数上涨 11.3%。

报告期间，MSCI 全球指数按美元计价上涨 12.2%，MSCI 新兴市场指数按美元计价上涨 6.5%，恒生指数按港币计价上涨 5.9%，黄金价格按美元计价下跌 6.8%，十年期美国国债、十年期日本国债及十年期德国国债收益率分别上升 55 个基点、4 个基点和 36 个基点。新兴市场方面，巴西圣保罗证交所指数按本币计价上涨 6.5%，印度 Nifty 指数按本币计价上涨 12.4%，俄罗斯 MOEX 指数按本币计价上涨 16.8%，美元指数小幅上行，由 89.94 上涨至 92.44。

港股市场方面，2021 年上半年恒生指数上涨 5.86%，恒生国企指数下跌 0.70%。从市值角度来看，恒生大型股指数上涨 3.50%，恒生中型股指数上涨 9.18%，恒生小型股指数上涨 16.49%。根据 Wind 统计，2021 年上半年港股通南下资金累计净买入 3886 亿元人民币，流入主要集中在第一季度。恒生 AH 股溢价指数于报告期内小幅回落，由 139.76 点下降至 138.89 点。

2021 年上半年港股市场出现了多次的逻辑切换，市场板块轮动速度加快，市场整体情绪在全球流动性泛滥带来的资产估值红利与全球整体经济增长中枢结构性下移的成长压力中间纠结。在低利率的环境下，现金流折现的估值框架下上市公司的价值更加“远期化”，新老经济上市公司估值呈现历史上罕见的两极化态势，资金对于可预见的近期现金流价值兴趣下降，对于非常远期的潜在现金流寄予了很高的期望。我们认为在新的技术红利迸发之前，全球以及中国自身总量经济增速放缓的大趋势较为明确，未来投资的重点在于把握居民消费习惯的结构性变化、产业政策的结构变化、行业竞争格局的结构性变化以及市场边界的结构性变化。未来投资机会的核心矛盾并不在于新老经济之间，而是在于在各个行业之间积极发掘结构性变化的机会，拥抱结构性变化的受益者，回避结构型变化的受损者。我们观察到结构性变化的主要形态包括但不限于以下主要方面：1) 消费者的需求随着社会年龄结构、文化演变、技术创新以及收入改变所形成的自然变化；2) 渠道结构变化带来的新品牌创新红利；3) 供给端强约束造成的部分商品或服务短期供不应求；4) 行业龙头优势提升，成本曲线陡峭化。在新的监管环境下，我们要不仅仅需要关注企业在发展中自

身获取经济利益的能力，同时要更加关注企业为社会带来的综合效益，“社会友好”型的企业在中长期更有望脱颖而出，获得更广阔的成长机遇。权益市场的投资环境在不断变化，但我们认为投资的本质始终没有改变，那就是保持理性，重视价值，面向长期。

现阶段，我们认为全球低利率环境的大背景较难出现根本改变，海外上市的中国资产从全球角度来看是最优质的资产类别之一，目前港股市场整体估值水平已经低于历史中枢水平，短期面临一定的市场情绪波动，但长期投资价值在提升，具备良好的长期配置价值。

大类资产配置方面，报告期内本基金保持了相对均衡的资产配置，一定程度上抵御了成长股大幅度调整的影响，有效控制了基金净值的回撤。在区域配置上，对除美国外的发达市场依然保持了谨慎的观点，超配美国、低配非美国发达市场，行业上增加了美国 REITs、全球新能源等行业和主题的配置。对港股保持了长期积极的观点，坚持以价值投资为导向，遵循自下而上为主的原则，利用内部投研一体的优势，在大消费、大科技、大周期、大金融四个行业投研团队的支持下，在行业中精选管理层优质、盈利长期成长强劲、估值水平合理的公司，并长期持有。报告期内，基金在保持港股行业长期相对均衡的配置的基础上，超配了可选消费、医药等新经济领域。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.266 元，报告期内，份额净值增长率为 7.55%，同期业绩基准增长率为 8.88%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们对于全球权益市场持相对乐观的判断。在全球新冠疫苗接种率大幅提升的背景下，以欧美为代表的发达经济体的持续推动复工复产政策效果明显，全球经济有较大概率继续上半年持续走好的态势。同时，全球主要经济体持续的宽松政策未来将进一步推升市场流动性，提升投资者的风险偏好。在风险方面，随着全球经济复苏的持续，通货膨胀的快速上行带来无风险收益率的上升会影响到风险资产的估值。但我们对于美联储的“收水”保持相对审慎的态度，一方面美国的就业市场离着疫情前的水平还有一定的距离，另一方面，新冠疫情在一些国家的反复也会在一定程度上缓解全球经济过热的担忧。我们依然维持对美联储 21 年底开始缩减购债规模，22 年底开始提升利率的判读。在对 21 年全球经济增长相对乐观的预判下，我们对于全球权益市场中长期依然保持相对乐观的判断，未来更加关注企业盈利实质改善的行业和公司的投资机会。

港股方面，我们依然维持乐观的判断。港股市场整体生态的变化将有助于吸引更多的南下资金以及海外资金沉淀在港股市场，对港股估值形成支持。同时，考虑到港股市场已经连续三年在全球主要股市中涨幅相对较为落后，在目前低利率环境下，相比于其他主要股市，港股估值层面仍然具有较好的相对优势。港股新经济领域上市公司数量的增加也提升了整个市场的长期投资价值。行业和个股层面，在持续关注新经济长期成长投资回报的同时对于基本面改善或者没有明显下滑、分红稳定、低估值的传统行业个股进行适当配置，保持整个组合长期稳定的投资策略和风格。

本基金投资团队通过大类资产配置、区域配置、行业配置和个股选择等多层面投资策略的实施，在控制基金的回撤水平，力争稳定战胜业绩比较基准，为投资者创造持续稳健的投资回报。

4.7 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。

4.8 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，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 60%，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按除权日的基金份额净值自动转为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；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；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，本基金本报告期内 2021 年 1 月 18 日已分配数（每 10 份基金份额派发红利 0.7 元）为 2020 年年度收益分配。

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方全球精选配置（QDII-FOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，南方全球精选配置（QDII-FOF）的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方全球精选配置（QDII-FOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方全球精选配置（QDII-FOF）于 2021 年 1 月 18 日对 2020 年年度收益进行了 1 次利润分配，分配金额为 159,489,617.49 元。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方全球精选配置（QDII-FOF）2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方全球精选配置证券投资基金

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	6.4.7.1	188,257,148.97	196,580,521.83
结算备付金		-	-
存出保证金		10,001,872.18	10,011,950.07
交易性金融资产	6.4.7.2	2,457,427,580.15	2,755,556,150.08
其中：股票投资		785,904,479.26	917,710,496.03
基金投资		1,671,523,100.89	1,837,845,654.05
债券投资		-	-
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	-	-
应收证券清算款		11,165,565.34	-
应收利息	6.4.7.5	7,696.04	10,346.03
应收股利		3,278,556.41	293,659.54
应收申购款		256,347.65	259,583.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,670,394,766.74	2,962,712,211.47
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		32.26	10,776,280.64
应付赎回款		13,887,016.21	20,409,507.63
应付管理人报酬		4,059,296.32	4,585,820.66
应付托管费		658,264.26	743,646.61
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	87,316.74	64,578.79
应交税费		346,553.11	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	116,149.36	235,878.26
负债合计		19,154,628.26	36,815,712.59
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,094,618,821.32	2,350,997,257.71
未分配利润	6.4.7.10	556,621,317.16	574,899,241.17
所有者权益合计		2,651,240,138.48	2,925,896,498.88
负债和所有者权益总计		2,670,394,766.74	2,962,712,211.47

6.2 利润表

会计主体：南方全球精选配置证券投资基金

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		238,188,074.05	212,038,539.35
1. 利息收入		138,137.44	280,496.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	138,137.44	280,496.95
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		347,108,009.37	160,100,516.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	179,151,794.71	109,517,572.67

基金投资收益	6.4.7.13	155,926,544.04	30,411,286.54
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	12,029,670.62	20,171,656.80
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.19	-105,717,218.54	48,098,326.21
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-3,371,448.27	3,482,939.22
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.20	30,594.05	76,260.96
减：二、费用		32,731,182.15	43,479,807.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	25,008,186.29	31,116,552.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,055,381.52	5,045,927.44
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.21	3,329,302.93	6,982,954.41
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		196,542.38	172,182.81
7. 其他费用	6.4.7.22	141,769.03	162,189.99
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		205,456,891.90	168,558,732.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		205,456,891.90	168,558,732.05

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方全球精选配置证券投资基金

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)	2,350,997,257.71	574,899,241.17	2,925,896,498.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	205,456,891.90	205,456,891.90
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)	-256,378,436.39	-64,245,198.42	-320,623,634.81
其中：1. 基金申购款	59,738,399.98	12,663,587.52	72,401,987.50
2. 基金赎回款	-316,116,836.37	-76,908,785.94	-393,025,622.31
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)	-	-159,489,617.49	-159,489,617.49
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,094,618,821.32	556,621,317.16	2,651,240,138.48
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)	3,524,988,750.04	224,510,280.96	3,749,499,031.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	168,558,732.05	168,558,732.05
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)	-553,717,708.96	-28,972,949.69	-582,690,658.65
其中：1. 基金申购款	27,275,140.73	736,439.57	28,011,580.30
2. 基金赎回款	-580,992,849.69	-29,709,389.26	-610,702,238.95

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）	-	-17,273,031.32	-17,273,031.32
五、期末所有者权益（基金净值）	2,971,271,041.08	346,823,032.00	3,318,094,073.08

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 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的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 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。

6.4.2 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。

6.4.2.1 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.3.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.3.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.3.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.4 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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[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]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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[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[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值作为买入价计算销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通或深港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。基金通过沪港通或深港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) 基金通过沪港通或深港通买卖、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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.5 重要财务报表项目的说明

6.4.5.1 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	188,257,148.97
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	188,257,148.97

注：货币资金中包括以下外币余额：

	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	外币金额	汇率	折合人民币
港元	102,148,503.90	0.83208	84,995,727.12
美元	3,003,458.73	6.4601	19,402,643.75
欧元	883.76	7.6862	6,792.76
日元	82.00	0.058428	4.79
合计			104,405,168.42

6.4.5.2 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	688,024,319.36	785,904,479.26	97,880,159.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	1,103,431,938.37	1,671,523,100.89	568,091,162.52
其他	-	-	-
合计	1,791,456,257.73	2,457,427,580.15	665,971,322.42

6.4.5.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.5.4 买入返售金融资产

6.4.5.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.5.4.2 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。

6.4.5.5 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	7,696.04
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	-
应收债券利息	-
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	-
合计	7,696.04

6.4.5.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.5.7 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	87,316.74
银行间市场应付交易费用	-
合计	87,316.74

6.4.5.8 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	3,049.36
应付证券出借违约金	-
预提费用	113,100.00
合计	116,149.36

6.4.5.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,350,997,257.71	2,350,997,257.71
本期申购	59,738,399.98	59,738,399.98
本期赎回（以“-”号填列）	-316,116,836.37	-316,116,836.37

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	2,094,618,821.32	2,094,618,821.32

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。

6.4.5.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	272,076,829.47	302,822,411.70	574,899,241.17
本期利润	311,174,110.44	-105,717,218.54	205,456,891.90
本期基金份额交易产生的变动数	-35,250,405.47	-28,994,792.95	-64,245,198.42
其中：基金申购款	6,448,761.31	6,214,826.21	12,663,587.52
基金赎回款	-41,699,166.78	-35,209,619.16	-76,908,785.94
本期已分配利润	-159,489,617.49	-	-159,489,617.49
本期末	388,510,916.95	168,110,400.21	556,621,317.16

6.4.5.11 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	135,741.28
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	1,929.38
其他	466.78
合计	138,137.44

6.4.5.12 股票投资收益

6.4.5.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	179,151,794.71
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	179,151,794.71

6.4.5.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

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

卖出股票成交总额	651,293,295.51
减：卖出股票成本总额	472,141,500.80
买卖股票差价收入	179,151,794.71

6.4.5.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.5.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.5.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.5.13 基金投资收益

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/赎回基金成交总额	950,039,525.98
减：卖出/赎回基金成本总额	794,112,981.94
基金投资收益	155,926,544.04

6.4.5.14 债券投资收益

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.5.15 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。

6.4.5.16 贵金属投资收益

6.4.5.16.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.5.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.5.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.5.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.5.17 衍生工具收益

6.4.5.17.1 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。

6.4.5.17.2 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。

6.4.5.18 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	8,730,996.80
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	3,298,673.82
合计	12,029,670.62

6.4.5.19 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	-105,717,218.54
——股票投资	-94,654,434.38
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-11,062,784.16
——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	-105,717,218.54

6.4.5.20 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	30,594.05
其他	-
合计	30,594.05

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.5.21 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	3,329,302.93
银行间市场交易费用	-
合计	3,329,302.93

6.4.5.22 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	49,092.63
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	787.00
其他	23,382.03
合计	141,769.03

6.4.6 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.6.1 或有事项

无。

6.4.6.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
纽约梅隆银行股份有限公司(“纽约梅隆银行”)	境外资产托管人
华泰金融控股(香港)有限公司(“华泰香港”)	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至
-------	-----------------------------	-------------------------

	月 30 日		2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰香港	240,988,519.56	22.85%	94,752,356.43	4.54%
华泰证券	-	-	47,602,746.71	2.28%

6.4.8.1.2 基金交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰香港	453,830,203.81	61.24%	189,105,646.36	11.04%

6.4.8.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 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
华泰香港	405,732.43	17.61%	-	-
华泰证券	-	-	-	-
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰香港	243,591.71	5.10%	-	-
华泰证券	37,149.31	0.78%	72,936.36	10.36%

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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	25,008,186.29	31,116,552.65
其中：支付销售机构的客户维护费	6,972,491.49	2,144,966.38

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 1.85%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.85\% / \text{当年天数}。$$

6.4.8.2.2 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	4,055,381.52	5,045,927.44

支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

6.4.8.2.3 销售服务费

无。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 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

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.5.2 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。

6.4.8.6 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
纽约梅隆银行	105,043,854.04	972.64	106,344,133.05	25,600.33
中国工商银行	83,213,294.93	134,768.64	93,247,867.06	223,950.13

注：本基金由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人纽约梅隆银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.8.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2021 年 1 月 18 日	-	2021 年 1 月 15 日	0.7000	106,893,939.99	52,595,677.50	159,489,617.49	-
合计	-	-	-	0.7000	106,893,939.99	52,595,677.50	159,489,617.49	-

6.4.10 期末（2021 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.10.1 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
2150 HK	奈雪的茶	2021.6.24	2021.12.30	基石配售	16.47	14.25	3,331,000	54,876,859.29	47,450,793.18	-
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

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

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、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。

6.4.10.2 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。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 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。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.11 金融工具风险及管理

6.4.11.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资、基金投资及衍生工具等。本基金在日常经营活动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。

6.4.11.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行及境外资产托管人纽约梅隆银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内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，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2020 年 12 月 31 日：同)。

6.4.11.3 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约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。

6.4.11.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金本报告期末及上年度末无金融资产和金融负债的到期期限分析。

6.4.11.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金无流动性受限资产。

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。

6.4.11.4 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。

6.4.11.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金和应收申购款等。

6.4.11.4.1.1 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	102,600,548.55	-	-	85,656,600.42	188,257,148.97
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	1,872.18	-	-	10,000,000.00	10,001,872.18
交易性金融资产	-	-	-	2,457,427,580.15	2,457,427,580.15
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	7,696.04	7,696.04
应收股利	-	-	-	3,278,556.41	3,278,556.41
应收申购款	6,091.21	-	-	250,256.44	256,347.65

应收证券清算款	-	-	-	11,165,565.34	11,165,565.34
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	102,608,511.94	-	-	2,567,786,254.80	2,670,394,766.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,887,016.21	13,887,016.21
应付管理人报酬	-	-	-	4,059,296.32	4,059,296.32
应付托管费	-	-	-	658,264.26	658,264.26
应付证券清算款	-	-	-	32.26	32.26
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	87,316.74	87,316.74
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	346,553.11	346,553.11
其他负债	-	-	-	116,149.36	116,149.36
负债总计	-	-	-	19,154,628.26	19,154,628.26
利率敏感度缺口	102,608,511.94	-	-	2,548,631,626.07	2,651,240,138.48
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	100,892,100.20	-	-	95,688,421.63	196,580,521.83
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	11,950.07	-	-	10,000,000.00	10,011,950.07
交易性金融资产	-	-	-	2,755,556,150.08	2,755,556,150.08
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	10,346.03	10,346.03
应收股利	-	-	-	293,659.54	293,659.54
应收申购款	14,173.00	-	-	245,410.92	259,583.92

应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	100,918,223.27	-	-	2,861,793,988.20	2,962,712,211.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	20,409,507.63	20,409,507.63
应付管理人报酬	-	-	-	4,585,820.66	4,585,820.66
应付托管费	-	-	-	743,646.61	743,646.61
应付证券清算款	-	-	-	10,776,280.64	10,776,280.64
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	64,578.79	64,578.79
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	235,878.26	235,878.26
负债总计	-	-	-	36,815,712.59	36,815,712.59
利率敏感度缺口	100,918,223.27	-	-	2,824,978,275.61	2,925,896,498.88

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。

6.4.11.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日,本基金未持有交易性债券投资(2020 年 12 月 31 日:同),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日:同)。

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

6.4.11.4.2.1 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						
银行存款	19,402,643.75	84,995,727.12	6,792.76	4.79	-	104,405,168.42
存出保证金	-	1,872.18	-	-	-	1,872.18
交易性金融资产	1,671,523,100.89	785,904,479.26	-	-	-	2,457,427,580.15
应收股利	32,600.89	2,669,949.52	-	-	-	2,702,550.41
应收证券清算款	-	11,165,565.34	-	-	-	11,165,565.34
资产合计	1,690,958,345.53	884,737,593.42	6,792.76	4.79	-	2,575,702,736.50
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	1,690,958,345.53	884,737,593.42	6,792.76	4.79	-	2,575,702,736.50

项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
银行存款	19,596,788.87	95,170,668.21	7,092.17	5.19	-	114,774,554.44
存出保证金	-	1,893.69	-	-	-	1,893.69
交易性金融资产	1,837,845,654.05	917,710,496.03	-	-	-	2,755,556,150.08
应收股利	785.08	32,874.46	-	-	-	33,659.54
资产合计	1,857,443,228.00	1,012,915,932.39	7,092.17	5.19	-	2,870,366,257.75
以外币计价的负债						

应付证券清算款	-	10,776,178.59	-	-	-	10,776,178.59
负债合计	-	10,776,178.59	-	-	-	10,776,178.59
资产负债表外汇风险敞口净额	1,857,443,228.00	1,002,139,753.80	7,092.17	5.19	-	2,859,590,079.16

6.4.11.4.2.2 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）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	128,785,136.83	142,979,503.96
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-128,785,136.83	-142,979,503.96	

6.4.11.4.3 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交易的股票和基金，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，采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的配置策略，在宏观经济与地区经济分析、掌握全球经济趋势的基础上，通过量化分析，确定资产种类与权重，并定期进行回顾和动态调整。本基金将全球股票市场分为成熟市场和新兴市场两类，根据全球经济以及区域化经济发展，结合全球范围的资本流动，确定两类市场具体的资产配置比例并定期进行调整，争取构建具备中长期发展潜力的资产组合。在成熟市场和新兴市场中根据不同国家和地区经济发展及证券市场的发展变化对资产进行国家及区域配置，在不同国家或地区的配置比例上采用“全球资产配置量化”模型进行配置和调整。由于短期市场会受到一些非理性或者非基本面因素的影响而产生波动，基金经理将根据对不同因素的研究与判断，对基金投资组合进行调整，以降低投资组合的投资风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中基金和股票投资比例为基金资产的 60%-100%，货币市场工具及其他金融工具占基金资产的 0%-40%。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。

6.4.11.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金本报告期末及上年度末无其他价格风险敞口。

6.4.11.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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.组合自身基准上升 5%	113,546,574.30	111,292,006.58
	2.组合自身基准下降 5%	-113,546,574.30	-111,292,006.58

6.4.12 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**

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	785,904,479.26	29.43
	其中：普通股	785,904,479.26	29.43
	存托凭证	-	-
2	基金投资	1,590,189,403.95	59.55
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	81,333,696.94	3.05
7	银行存款和结算备付 金合计	188,257,148.97	7.05
8	其他资产	24,710,037.62	0.93
9	合计	2,670,394,766.74	100.00

注：1、上述货币市场工具均为货币市场基金投资。

2、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 146,353,769.88 元，占基金资产净值比例 5.52%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	785,904,479.26	29.64
合计	785,904,479.26	29.64

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	14,694,532.80	0.55
材料	1,714.92	0.00
工业	6,318,233.06	0.24
非必需消费品	222,123,143.59	8.38
必需消费品	62,944,122.78	2.37
医疗保健	62,400,882.71	2.35
金融	97,758,582.96	3.69
科技	53,585,952.00	2.02
通讯	120,673,766.61	4.55
公用事业	33,399,691.20	1.26
房地产	112,003,856.63	4.22
政府	-	-
合计	785,904,479.26	29.64

注：本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Excellence Commercial Property & Facilities Management	卓越商企服务集团有限公司	6989 HK	中国香港联合交易所	中国香港	9,009,100	63,493,592.63	2.39

	ment Group Limited							
2	AIA Group Limited	友邦保险控股有限公司	1299 HK	中国香港联合交易所	中国香港	618,000	49,622,754.96	1.87
3	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	0700 HK	中国香港联合交易所	中国香港	100,000	48,593,472.00	1.83
4	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	香港交易及结算有限公司	0388 HK	中国香港联合交易所	中国香港	125,000	48,135,828.00	1.82
5	Nayuki Holdings Limited	奈雪的茶控股有限公司	2150 HK	中国香港联合交易所	中国香港	3,331,000	47,450,793.18	1.79
6	China New Higher Education Group Limited	中国新高教集团有限公司	2001 HK	中国香港联合交易所	中国香港	10,000,000	44,266,656.00	1.67
7	Cathay Media And Education Group Inc.	华夏视听教育集团	1981 HK	中国香港联合交易所	中国香港	9,329,000	41,917,361.33	1.58
8	Xiaomi Corporation	小米集团	1810 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,500,000	33,699,240.00	1.27
9	China Longyu an Power Group Corporation	龙源电力集团股份有限公司	0916 HK	中国香港联合交易所	中国香港	3,000,000	33,399,691.20	1.26

	Limited							
10	Hygeia Healthcare Holdings Co., Limited	海吉亚医疗控股有限公司	6078 HK	中国香港联合交易所	中国香港	390,000	33,100,142.40	1.25
11	Neusoft Education Technology Co. Limited	东软教育科技有限公司	9616 HK	中国香港联合交易所	中国香港	5,769,600	29,236,681.80	1.10
12	China Resources Land Limited	华润置地有限公司	1109 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,000,000	26,168,916.00	0.99
13	China Telecom Corporation Limited	中国电信股份有限公司	0728 HK	中国香港联合交易所	中国香港	10,000,000	24,213,528.00	0.91
14	Shimao Services Holdings Limited	世茂服务控股有限公司	0873 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,000,000	22,341,348.00	0.84
15	Man Wah Holdings Limited	敏华控股有限公司	1999 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,380,000	21,426,725.66	0.81
16	China East Education Holdings Limited	中国东方教育控股有限公司	0667 HK	中国香港联合交易所	中国香港	2,000,000	20,302,752.00	0.77
17	China Mobile Limited	中国移动有限公司	0941 HK	中国香港联合交易所	中国香港	500,000	20,198,742.00	0.76
18	Semiconductor	中芯国际集成	0981 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,000,000	19,886,712.00	0.75

	Manuf acturing Internati onal Corpora tion	电路制 造有限 公司		交易所				
19	Kuaisho u Technol ogy	快手科 技	1024 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	121,800	19,742, 462.61	0.74
20	Venus Medtec h (Hangzh ou) Inc.	杭州启 明医疗 器械股 份有限 公司	2500 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	350,000	18,857, 013.00	0.71
21	Zhou Hei Ya Internati onal Holdings Company Limited	周黑鸭 国际控 股有限 公司	1458 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	2,000,0 00	15,493, 329.60	0.58
22	ANTA Sports Product s Limited	安踏体 育用品 有限公 司	2020 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	100,000	15,210, 422.40	0.57
23	CNOOC Limited	中国海 洋石油 有限公 司	0883 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	2,000,0 00	14,694, 532.80	0.55
24	China Yuhua Educati on Corpora tion Limited	中国宇 华教育 集团有 限公司	6169 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	2,500,0 00	14,623, 806.00	0.55
25	China Yongda Automob iles	中国永 达汽车 服务控 股有限	3669 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	1,000,0 00	11,565,9 12.00	0.44

	Services Holding s Limited	公司						
26	Akeso, Inc.	康方生物科技(开曼)有限公司	9926 HK	中国香港联合交易所	中国香港	200,000	10,425,962.40	0.39
27	China Kepei Education Group Limited	中国科培教育集团有限公司	1890 HK	中国香港联合交易所	中国香港	2,000,000	9,319,296.00	0.35
28	CMGE Technology Group Limited	中手游科技集团有限公司	0302 HK	中国香港联合交易所	中国香港	2,500,000	7,925,562.00	0.30
29	Hope Education Group Co., Ltd.	希望教育集团有限公司	1765 HK	中国香港联合交易所	中国香港	5,000,000	7,779,948.00	0.29
30	Edvantage Group Holdings Limited	中汇集团控股有限公司	0382 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,000,000	6,473,582.40	0.24
31	Hainan Meilan International Airport Company Limited	海南美兰国际空港股份有限公司	0357 HK	中国香港联合交易所	中国香港	234,000	6,318,233.06	0.24
32	Zylox-Tonbridge Medical Technol	归创通桥医疗科技股份有限公司	2190 HK	中国香港联合交易所	中国香港	500	17,764.91	0.00

	ogy Co., Ltd.							
33	Shandong Gold Mining Co., Ltd.	山东黄金矿业股份有限公司	1787 HK	中国香港联合交易所	中国香港	150	1,714.92	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Nayuki Holdings Limited	2150 HK	54,876,859.29	1.88
2	China Longyuan Power Group Corporation Limited	916 HK	38,637,943.53	1.32
3	Xiaomi Corporation	1810 HK	32,320,673.66	1.10
4	China East Education Holdings Limited	667 HK	27,287,104.88	0.93
5	China Telecom Corporation Limited	728 HK	26,318,565.20	0.90
6	Kuaishou Technology	1024 HK	22,337,670.26	0.76
7	Semiconductor Manufacturing International Corporation	981 HK	21,463,375.83	0.73
8	Cathay Media And Education Group Inc.	1981 HK	20,470,420.38	0.70
9	Man Wah Holdings Limited	1999 HK	18,489,390.53	0.63
10	Jd Logistics, Inc.	2618 HK	12,664,362.60	0.43
11	Shimao Services Holdings Limited	873 HK	11,697,447.67	0.40
12	Hope Education Group Co., Ltd.	1765 HK	11,462,015.34	0.39
13	ANTA Sports Products Limited	2020 HK	10,944,048.22	0.37

14	E-Star Commercial Management Company Limited	6668 HK	10,782,677.13	0.37
15	Scholar Education Group	1769 HK	10,735,399.68	0.37
16	China Kepei Education Group Limited	1890 HK	9,565,592.65	0.33
17	AAC Technologies Holdings Inc.	2018 HK	7,648,568.92	0.26
18	Neusoft Education Technology Co. Limited	9616 HK	7,542,509.59	0.26
19	China Mobile Limited	941 HK	7,250,830.03	0.25
20	Hainan Meilan International Airport Company Limited	357 HK	6,580,162.25	0.22

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Hygeia Healthcare Holdings Co., Limited	6078 HK	216,985,470.12	7.42
2	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	38,976,199.12	1.33
3	Inspur International Limited	596 HK	33,359,893.22	1.14
4	Hong Kong	388 HK	22,946,226.50	0.78

	Exchanges and Clearing Ltd.			
5	China Longyuan Power Group Corporation Limited	916 HK	22,295,851.29	0.76
6	CNOOC Limited	883 HK	22,255,759.44	0.76
7	AIA Group Limited	1299 HK	21,863,218.12	0.75
8	Huaneng Power International, Inc.	902 HK	21,362,398.61	0.73
9	China Feihe Limited	6186 HK	18,592,598.00	0.64
10	Longfor Group Holdings Limited	960 HK	17,894,824.13	0.61
11	China Jinmao Holdings Group Limited	817 HK	17,488,577.32	0.60
12	Ever Sunshine Lifestyle Services Group Limited	1995 HK	17,145,675.00	0.59
13	Jd Logistics, Inc.	2618 HK	15,169,609.86	0.52
14	Kingsoft Corporation Limited	3888 HK	14,644,015.93	0.50
15	E-Star Commercial Management Company Limited	6668 HK	13,068,754.92	0.45
16	Q Technology (Group) Company Limited	1478 HK	12,911,024.53	0.44
17	China Telecom Corporation Limited	728 HK	11,231,524.23	0.38
18	Cathay Media And Education Group Inc.	1981 HK	11,102,235.58	0.38
19	Zhou Hei Ya International Holdings	1458 HK	8,135,819.12	0.28

	Company Limited			
20	Scholar Education Group	1769 HK	7,292,323.12	0.25

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	403,436,420.64
卖出收入（成交）总额	651,293,295.51

注：买入成本和卖出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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	Wellington Global Quality	股票型基金	契约型开放式	Wellington Luxembourg Sarl	444,160,299.44	16.75

	Growth Fund					
2	T Rowe Price Funds SICAV - Global Focused Growth Equity Fund	股票型基金	契约型开放式	T Rowe Price Luxembourg Management Sarl	426,797,488.67	16.10
3	Wellington Global Health Care Equity Fund	股票型基金	契约型开放式	Wellington Management Group LLP	343,670,472.29	12.96
4	Vanguard Real Estate ETF	ETF 基金	交易型开放式	Vanguard Group Inc/The	131,514,715.80	4.96
5	iShares Global Clean Energy ETF	ETF 基金	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	90,932,367.60	3.43
6	BNY Mellon U.S. Dollar Liquidity Fund	货币市场基金	契约型开放式	BNY Mellon Fund Management Luxembourg SA	81,333,696.94	3.07
7	iShares MSCI USA Min Vol Factor ETF	ETF 基金	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	71,329,194.15	2.69
8	Invesco China Technology ETF	ETF 基金	交易型开放式	Invesco Capital Management LLC	54,394,042.00	2.05
9	Global X Uranium ETF	ETF 基金	交易型开放式	Global X Management Co LLC	27,390,824.00	1.03

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	10,001,872.18
2	应收证券清算款	11,165,565.34
3	应收股利	3,278,556.41
4	应收利息	7,696.04
5	应收申购款	256,347.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,710,037.62

7.11.4 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债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 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

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
159,212	13,156.16	7,563,351.97	0.36%	2,087,055,469.35	99.64%

8.2 期末上市基金前十名持有人

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	740,737.54	0.0354%
------------------	------------	---------

8.4 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2007年9月19日)基金份额总额	29,998,151,206.40
本报告期期初基金份额总额	2,350,997,257.71
本报告期基金总申购份额	59,738,399.98
减：报告期基金总赎回份额	316,116,836.37
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	2,094,618,821.32

§ 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。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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	
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	240,988,519.54	22.85%	405,732.40	17.61%	-
China Renaissance Securities (HK) Limited	-	108,890,845.92	10.32%	153,577.29	6.67%	-
UBS Securities Asia Limited	-	100,645,617.37	9.54%	184,276.23	8.00%	-
Haitong Internation	-	95,706,215.70	9.07%	209,685.49	9.10%	-

al Securities Co.,Ltd						
广发证券	1	92,786,404.78	8.80%	87,316.74	3.79%	-
China Merchants Securities(HK)Co Ltd	-	72,925,689.32	6.91%	72,925.70	3.17%	-
GuangFa Securities (Hong Kong)Business Limited	-	70,018,362.79	6.64%	195,520.96	8.49%	-
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	-	61,892,090.81	5.87%	58,589.69	2.54%	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	58,742,099.54	5.57%	107,397.95	4.66%	-
CMB International Securities Limited	-	54,876,859.29	5.20%	548,768.59	23.82%	-
Sanford C. Bernstein Limited	-	50,777,948.46	4.81%	50,777.95	2.20%	-
BOCI Securities Limited	-	13,324,578.17	1.26%	13,324.58	0.58%	-
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	12,416,474.75	1.18%	76,868.70	3.34%	-

China Constructi on Bank Internation al Securities Limited	-	10,782,677.13	1.02%	107,826.77	4.68%	-
Credit Suisse(Ho ng Kong) Limited	-	7,801,560.36	0.74%	9,361.87	0.41%	-
CLSA Limited	-	2,153,772.22	0.20%	21,537.72	0.94%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	453,830,203.80	61.24%
China Renaissance Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	163,921,353.96	22.12%
Haitong International Securities Co.,Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities (HK)Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
GuangFa Securities (Hong Kong)Business Limited	-	-	-	-	-	-	80,348,850.80	10.84%
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	-	-	-	-	-	-	-	-
China Internatio	-	-	-	-	-	-	-	-

nal Capital Corporati on Hong Kong Securities Limited									
CMB Internatio nal Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	42,968,12 7.70	5.80%	
China Constructi on Bank Internatio nal Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse(Ho ng Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：券商选择标准和程序：

为保障公司境外证券投资的顺利开展，规范券商选择及交易量分配标准与原则，基金管理人明确了券商选择、考核及交易量的分配等流程。

A. 券商的选择

券商的交易及清算执行能力、研究实力和提供的研究服务等，这是选择券商以及分配交易量最主要的原则和标准，包括以下几个方面：

交易及清算执行能力。主要指券商是否对投资指令进行了有效的执行、能否取得较高质量的成交结果以及成交以后的清算完成情况。衡量交易执行能力的指标主要有：是否完成交易、成交的及时性、成交价格、对市场的影响、清算系统的能力与清算时效性等；

研究机构的实力和水平。主要是指券商能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告，报告内容是否详实，投资建议是否准确；

提供研究服务的质量。主要指券商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。

其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

B. 券商交易量分仓

公司将定期根据交易执行能力、研究机构的实力和水平、提供专业服务的质量等标准对交易券商进行打分考核，并根据考核结果拟定下期的交易量分配。

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	关于南方全球精选配置证券投资基金 2021 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	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	2021-01-05
2	南方基金管理股份有限公司关于北京恒宇天泽基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	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	2021-01-07
3	南方全球精选配置证券投资基金限制大额申购和定投业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-13
4	南方全球精选配置证券投资基金分红公告	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	2021-01-14
5	南方全球精选配置证券投资基金恢复大额申购和定投业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-19
6	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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会	2021-03-31

		会基金电子披露网站	
7	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	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
8	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	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	2021-04-08
9	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	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	2021-06-08
10	南方基金管理股份有限公司关于大河财富基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	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	2021-06-18

§ 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全球精选配置证券投资基金的文件；
- 2、《南方全球精选配置证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方全球精选配置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、《南方全球精选配置证券投资基金 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>