

南方浩益进取聚申 3 个月持有期混合 型基金中基金（FOF）2022 年第 2 季度 报告

2022 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 7 月 21 日

§ 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 4 月 26 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南方浩益进取聚申 3 个月持有混合（FOF）
基金主代码	014934
交易代码	014934
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 4 月 26 日
报告期末基金份额总额	347,712,848.51 份
投资目标	本基金是基金中基金，通过大类资产配置，投资于多种具有不同风险收益特征的基金，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金力争通过合理判断市场走势，合理配置基金、股票、债券等投资工具的比例，通过定量和定性相结合的方法精选具有不同风险收益特征的基金，力争实现基金资产的稳定回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+上证国债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金中基金、债券型基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。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。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司

基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方浩益进取聚申 3 个月持有混合（FOF）A	南方浩益进取聚申 3 个月持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	014934	014935
报告期末下属分级基金的份额总额	245,254,649.85 份	102,458,198.66 份

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“南方浩益进取聚申 3 个月持有混合（FOF）”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	2022 年 4 月 26 日(基金合同生效日)-2022 年 6 月 30 日	
	南方浩益进取聚申 3 个月持有混合（FOF）A	南方浩益进取聚申 3 个月持有混合（FOF）C
1.本期已实现收益	3,084,635.65	1,169,535.93
2.本期利润	6,153,580.36	2,446,693.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0251	0.0241
4.期末基金资产净值	251,411,120.13	104,918,051.28
5.期末基金份额净值	1.0251	1.0240

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认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、本基金 T 日的基金份额净值在所投资基金披露净值或万分收益的当日（法定节假日顺延至第一个交易日）计算，并于 T+3 日公告。

4、本基金合同于 2022 年 4 月 26 日生效，截至本报告期末基金成立未满一季度。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

南方浩益进取聚申 3 个月持有混合（FOF）A

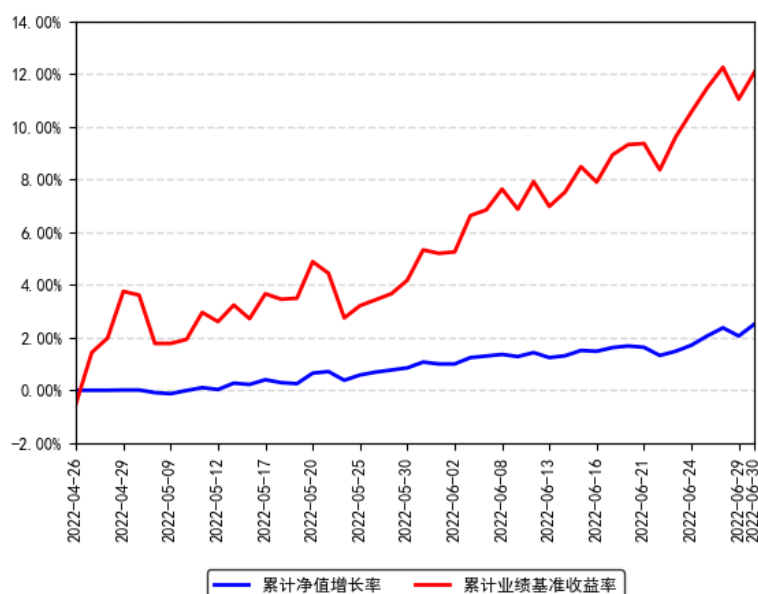
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	2.51%	0.17%	12.07%	0.83%	-9.56%	-0.66%

南方浩益进取聚申 3 个月持有混合（FOF）C

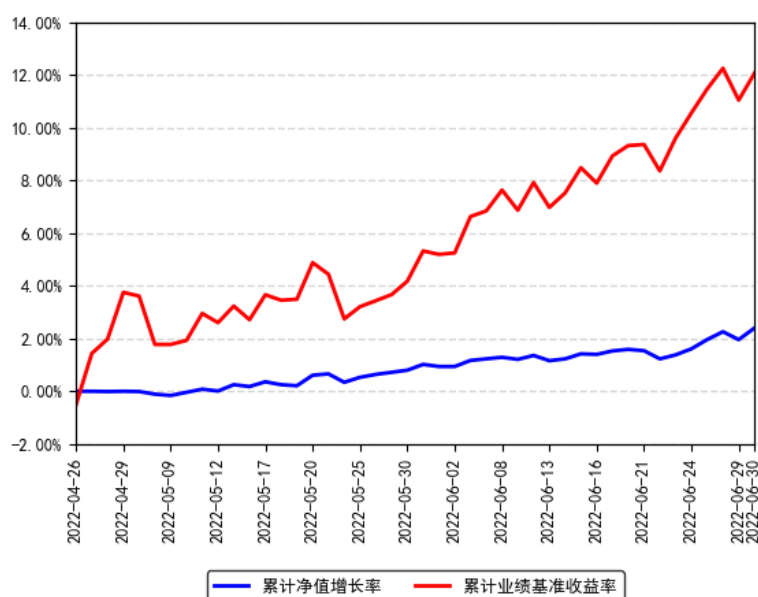
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	2.40%	0.17%	12.07%	0.83%	-9.67%	-0.66%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

南方浩益进取聚申3个月持有混合（FOF）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



南方浩益进取聚申3个月持有混合（FOF）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 2022 年 4 月 26 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，截至报告期末建仓期尚未结束。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李文良	本基金基金经理	2022年4月26日	-	13年	四川大学经济学学士，具有基金从业资格。曾先后就职于富士康集团财务部、晨星资讯全球基金及养老金管理部、招商银行总行基金团队，历任财务报表分析员、基金数据分析员、投资分析与组合构建组长、基金产品规划经理。2017年10月加入南方基金，曾任宏观研究与资产配置部研究员、FOF投资部负责人，现任FOF投资部总经理；2018年3月8日至今，任南方全天候策略基金经理；2021年7月27日至今，任南方富瑞稳健养老（FOF）基金经理；2021年9月29日至今，任南方富誉稳健养老目标一年持有混合（FOF）基金经理；2022年4月26日至今，任南方浩益进取聚申3个月持有混合（FOF）基金经理；2022年6月2日至今，任南方誉泰稳健6个月持有混合（FOF）基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

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。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2022 年二季度市场表现，在疫情发酵到疫情缓解，停工停产到复工复产，A 股市场也迎来深 V 反弹走势，六月份相较于海外市场继续大幅下跌 A 股市场走出明显的独立行情。风格来看，价值跌幅较小而反弹也较弱，成长板块跌幅大而反弹幅度较大。二季度债市整体收涨，十年期国债收益率维持区间震荡，转债资产随正股 V 型走势。从通胀交易到衰退预期交易，大宗商品在二季度冲高回落。

南方浩益进取成立于 4 月底，在 5~6 月份处于建仓期采取稳步建仓策略，在市场较低位置建仓节奏较为积极，在市场大幅修复后放慢了建仓节奏，在市场波动中积极把握建仓机会。在风格上，考虑组合在起步阶段，同时由于成长板块反弹幅度大幅大于价值板块，因此组合建仓采取均衡偏价值的风格，在债券品种配置上也以短端品种配置为主。在市场修复中，南方浩益进取在起步阶段取得了净值平稳增长。

4.5 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 1.0251 元，报告期内，份额净值增长率为 2.51%，同期业绩基准增长率为 12.07%；本基金 C 份额净值为 1.0240 元，报告期内，份额净值增长率为 2.40%，同期业绩基准增长率为 12.07%。

4.6 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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	50,211,611.17	14.08
	其中：股票	50,211,611.17	14.08
2	基金投资	269,061,611.63	75.43
3	固定收益投资	17,476,871.94	4.90
	其中：债券	17,476,871.94	4.90
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,831,965.07	5.00
8	其他资产	2,135,084.53	0.60
9	合计	356,717,144.34	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 1,809,107.41 元，占基金资产净值比例 0.51%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	632,700.00	0.18
B	采矿业	1,423,500.00	0.40
C	制造业	24,785,910.45	6.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,192,500.00	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	6,818,719.04	1.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,128,600.00	0.32
J	金融业	1,870,000.00	0.52
K	房地产业	537,600.00	0.15
L	租赁和商务服务业	2,197,500.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	5,289,894.27	1.48
N	水利、环境和公共设施管理业	1,525,580.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	48,402,503.76	13.58

5.2.2 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	1,433,298.44	0.40
工业	375,808.97	0.11
非必需消费	-	-
必需消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
科技	-	-
通讯	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
政府	-	-
合计	1,809,107.41	0.51

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	688105	诺唯赞	34,639	2,940,851.10	0.83
2	600009	上海机场	50,000	2,835,000.00	0.80
3	300760	迈瑞医疗	8,000	2,505,600.00	0.70
4	600887	伊利股份	60,000	2,337,000.00	0.66
5	300026	红日药业	300,000	2,310,000.00	0.65
6	600057	厦门象屿	250,000	2,197,500.00	0.62
7	300755	华致酒行	50,000	2,192,500.00	0.62
8	002507	涪陵榨菜	60,000	2,071,200.00	0.58
9	601567	三星医疗	150,000	1,992,000.00	0.56
10	000776	广发证券	100,000	1,870,000.00	0.52

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。

5.4 报告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	17,279,857.26	4.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	197,014.68	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,476,871.94	4.90

5.5 报告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

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	019664	21 国债 16	170,000	17,279,857.26	4.85
2	113060	浙 22 转债	1,970	197,014.68	0.06

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

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

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	69,032.08
2	应收证券清算款	2,000,026.22
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	66,026.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,135,084.53

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§ 6 基金中基金

6.1 报告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

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额	公允价值	占基金资	是否属于
----	------	------	------	------	------	------	------

				(份)	(元)	产净值比例 (%)	基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	009615	南方中债 0-2 年国 开行债券 指数 A	契约型开 放式	39,681,70 0.62	40,213,43 5.41	11.29	是
2	006491	南方中债 1-3 年国 开行债券 指数 A	契约型开 放式	39,411,79 5.76	40,196,09 0.50	11.28	是
3	511360	海富通中 证短融 ETF	契约型开 放式	300,000.0 0	31,590,30 0.00	8.87	否
4	008122	南方皓元 短债债券 A	契约型开 放式	27,703,38 9.05	30,138,51 6.95	8.46	是
5	007790	南方梦元 短债债券 A	契约型开 放式	28,021,67 0.09	30,131,70 1.85	8.46	是
6	006151	南方交元 债券	契约型开 放式	18,735,36 3.00	20,014,98 8.29	5.62	是
7	011117	富国沪港 深业绩驱 动混合 C	契约型开 放式	5,723,770 .82	10,507,69 8.47	2.95	否
8	511880	银华日利 交易货币 A	契约型开 放式	100,000.0 0	10,104,90 0.00	2.84	否
9	511990	华宝现金 添益交易 货币 A	契约型开 放式	100,293.0 0	10,029,19 9.71	2.81	否
10	513550	华泰柏瑞 中证港股 通 50ETF	契约型开 放式	10,000,00 0.00	8,360,000 .00	2.35	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2022-04-26 至 2022-06-30	其中: 交易及持有基金管理人 以及管理人关联方所管理基 金产生的费用
当期交易基金产生的申购费 (元)	1,100.00	-

当期交易基金产生的赎回费（元）	55,403.20	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	31,659.49	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	155,257.48	55,235.34
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	34,839.82	14,085.72

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期南方浩益进取聚申 3 个月持有混合 FOF 持有的基金未发生重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方浩益进取聚申 3 个月持有混合（FOF）A	南方浩益进取聚申 3 个月持有混合（FOF）C
基金合同生效日(2022 年 4 月 26 日)基金份额总额	245,068,910.92	101,443,877.90
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	185,738.93	1,014,320.76
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）	-	-
报告期期末基金份额总额	245,254,649.85	102,458,198.66

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	份额
基金合同生效日管理人持有的本基金份额	20,011,500.00
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	20,011,500.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	5.76

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、《南方浩益进取聚申 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 2、《南方浩益进取聚申 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
- 3、南方浩益进取聚申 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）2022 年 2 季度报告原文。

10.2 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。

10.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>