

南方优质企业混合型证券投资基金 2022 年中期报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|----|
| §1 重要提示及目录..... | 1 |
| 1.1 重要提示..... | 1 |
| 1.2 目录..... | 2 |
| §2 基金简介..... | 4 |
| 2.1 基金基本情况..... | 4 |
| 2.2 基金产品说明..... | 4 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 4 |
| 2.4 信息披露方式..... | 5 |
| 2.5 其他相关资料..... | 5 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现..... | 5 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 5 |
| 3.2 基金净值表现..... | 6 |
| §4 管理人报告..... | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 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..... | 11 |
| 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明..... | 11 |
| §5 托管人报告..... | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 12 |
| §6 中期财务会计报告（未经审计）..... | 12 |
| 6.1 资产负债表..... | 12 |
| 6.2 利润表..... | 14 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 15 |
| 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..... | 41 |
| 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..... | 42 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 44 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 46 |
| 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..... | 46 |
| 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..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 47 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 47 |

| | |
|---|----|
| 7.12 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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 49 |
| 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..... | 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..... | 50 |
| 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..... | 50 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 50 |
| 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..... | 52 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 53 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 53 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 53 |
| §12 备查文件目录..... | 53 |
| 12.1 备查文件目录..... | 53 |
| 12.2 存放地点..... | 53 |
| 12.3 查阅方式..... | 53 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---------------------|--------------------|------------------|
| 基金名称 | 南方优质企业混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 南方优质企业混合 | |
| 基金主代码 | 011216 | |
| 交易代码 | 011216 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 3 月 10 日 | |
| 基金管理人 | 南方基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,147,414,546.37 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 南方优质企业混合 A | 南方优质企业混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 011216 | 011217 |
| 报告期末下属分级基金的份 额总额 | 1,001,411,113.99 份 | 146,003,432.38 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金依托于基金管理人的投资研究平台，紧密跟踪中国产业结构的发展方向，精选质地优秀、具备长期价值增长潜力的上市公司。股票投资采用定量和定性分析相结合的策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+上证国债指数收益率×30% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，一般而言，其预期风险收益水平高于债券基金与货币市场型基金，低于股票型基金。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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 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 |
| | | 秦一楠 |
| | | 010-66060069 |
| | | tgxxpl@abchina.com |

| | | |
|--------|--|---------------------------------|
| 客户服务电话 | 400-889-8899 | 95599 |
| 传真 | 0755-82763889 | 010-68121816 |
| 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 | 北京东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码 | 518017 | 100031 |
| 法定代表人 | 周易 | 谷澍 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | 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 |

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、南方优质企业混合 A

| | |
|---------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | -77,711,975.80 |
| 本期利润 | -91,791,360.88 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0889 |
| 本期加权平均净值利润率 | -10.25% |
| 本期基金份额净值增长率 | -8.14% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | -73,786,972.35 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0737 |
| 期末基金资产净值 | 927,624,141.64 |
| 期末基金份额净值 | 0.9263 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | -7.37% |

2、南方优质企业混合 C

| | |
|---------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | -11,793,988.31 |
| 本期利润 | -13,978,192.02 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0919 |
| 本期加权平均净值利润率 | -10.66% |
| 本期基金份额净值增长率 | -8.41% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | -11,815,007.91 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0809 |
| 期末基金资产净值 | 134,188,424.47 |
| 期末基金份额净值 | 0.9191 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | -8.09% |

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方优质企业混合 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 | 10.42% | 1.40% | 5.72% | 0.73% | 4.70% | 0.67% |
| 过去三个月 | 8.35% | 1.74% | 4.13% | 1.00% | 4.22% | 0.74% |
| 过去六个月 | -8.14% | 1.76% | -5.73% | 1.03% | -2.41% | 0.73% |
| 过去一年 | -17.01% | 1.67% | -8.25% | 0.86% | -8.76% | 0.81% |
| 自基金合同生效起至今 | -7.37% | 1.54% | -4.43% | 0.81% | -2.94% | 0.73% |

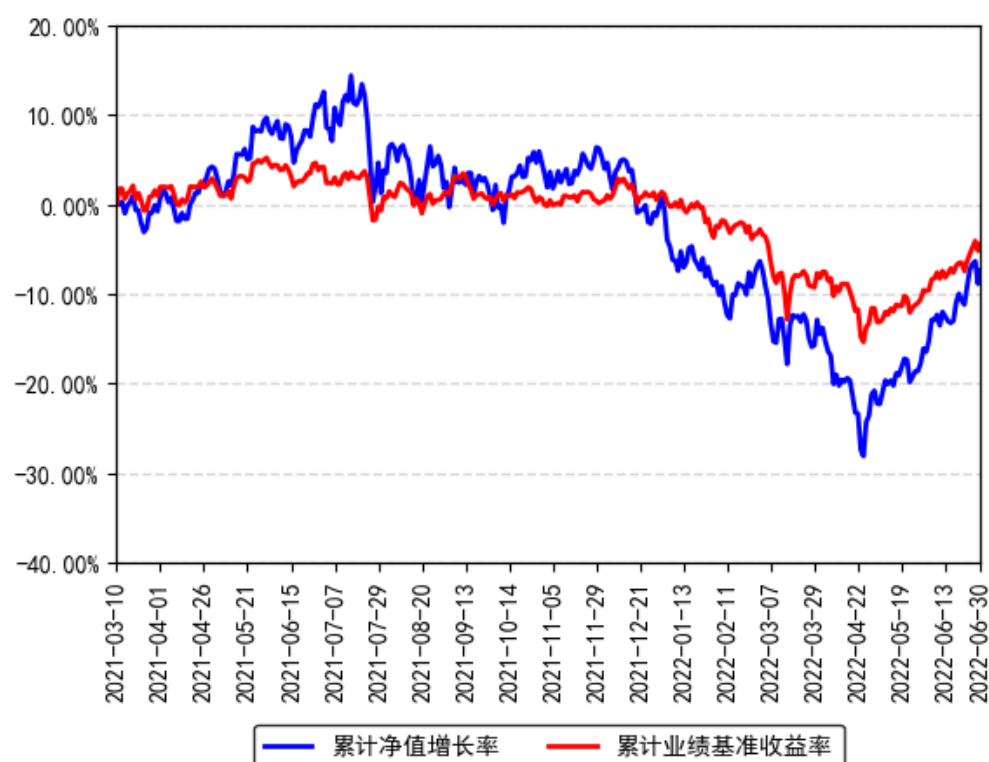
南方优质企业混合 C

| 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 | 10.38% | 1.40% | 5.72% | 0.73% | 4.66% | 0.67% |

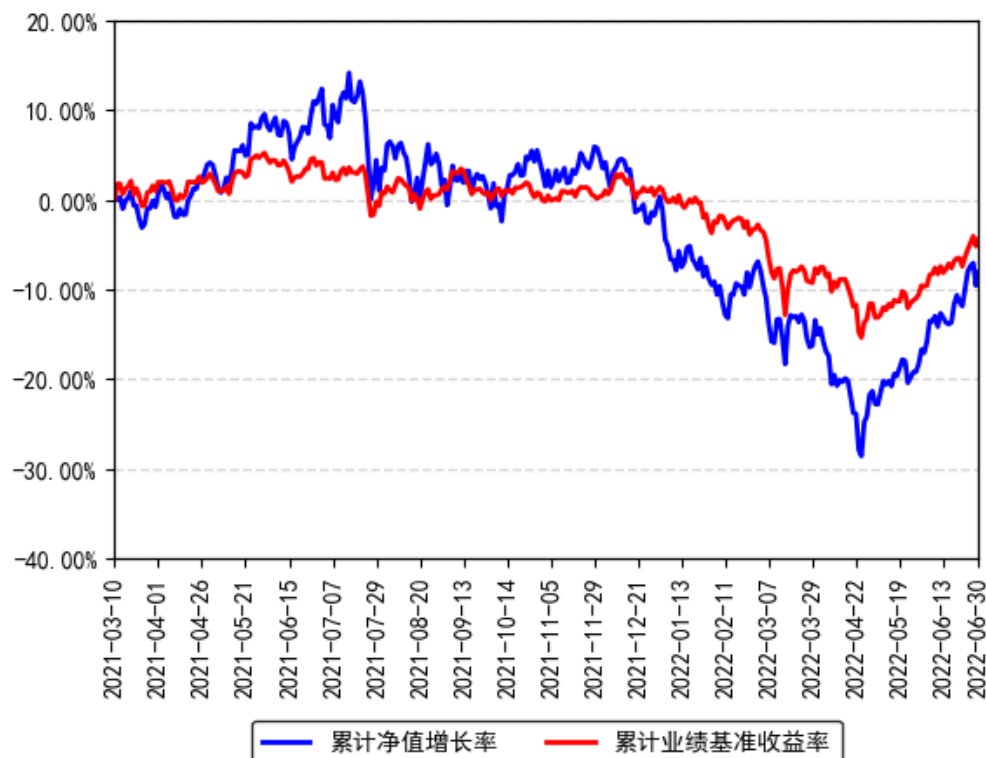
| | | | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | 8.19% | 1.74% | 4.13% | 1.00% | 4.06% | 0.74% |
| 过去六个月 | -8.41% | 1.76% | -5.73% | 1.03% | -2.68% | 0.73% |
| 过去一年 | -17.50% | 1.67% | -8.25% | 0.86% | -9.25% | 0.81% |
| 自基金合同生效起至今 | -8.09% | 1.54% | -4.43% | 0.81% | -3.66% | 0.73% |

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

南方优质企业混合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



南方优质企业混合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：本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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)1.72%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.24%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.25%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.32%。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 1.69 万亿元，旗下管理 296 只公募基金，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 | | |
| 应帅 | 本基金基金经理 | 2021 年 3 月 10 日 | - | 20 年 | 北大光华管理学院管理学硕士，具有基金从业资格。曾担任长城基金管理公司行业研究员，2007 年加入南方基金，2007 年 5 月 10 日至 2009 年 2 月 10 日，任南方宝元基金经理；2007 年 5 月 10 日至 2012 年 11 月 23 日，任南方成份基金经理；2010 年 12 月 2 日至 2016 年 3 月 30 日，任南方宝元基金经理；2017 年 8 月 3 日至 2021 年 6 月 17 日，任南方智造股票基金经理；2012 年 11 月 23 日至今，任南方稳健、南稳贰号基金经理；2016 年 3 月 23 日至今，任南方驱动基金经理；2020 年 9 月 1 日至今，任创业 LOF 基金经理；2020 年 9 月 29 日至今，兼任投资经理；2020 年 12 月 7 日至今，任南方产业升级混合基金经理；2021 年 3 月 10 日至今，任南方优质企业混合基金经理；2021 年 9 月 23 日至今，任南方蓝筹成长混合基金经理。 |

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值(元) | 任职时间 |
|----|----------|---------|-------------------|------------------|
| 应帅 | 公募基金 | 7 | 9,686,734,466.76 | 2007 年 5 月 10 日 |
| | 私募资产管理计划 | 1 | 524,641,555.55 | 2020 年 12 月 22 日 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 8 | 10,211,376,022.31 | - |

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为2次，是由于投资组合的投资策略需要以及接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年第一季度，市场普遍回调，第二季度的4月份市场继续下探，5月份市场终于迎来较好反弹，进入6月份，市场虽偶尔调整，但整体出现持续震荡上涨的态势。总体而言，A股市场上半年先调整后反弹，市场情绪开始转暖。但市场结构分化也还是比较明显，煤炭、房地产、建筑等稳增长板块在第一季度表现较强，但第二季度表现就比较一般，而最先调整的新能源包括汽车、风电和光伏等板块在5月和6月持续大幅度反弹，军工也表现不错，而消费和医药表现则继续低迷。本基金今年上半年仓位稳定，行业配置主要集中在新能源、白酒和军工。未来本基金还将继续以绝对收益为投资理念，自下而上，精选个股，力争持续为持有人创造收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 0.9263 元，报告期内，份额净值增长率为-8.14%，同期业绩基准增长率为-5.73%；本基金 C 份额净值为 0.9191 元，报告期内，份额净值增长率为-8.41%，同期业绩基准增长率为-5.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年上半年，国际形势以及宏观经济都比较复杂，充满不确定性。美联储加息、俄乌冲突、大宗商品价格高企、国内疫情等因素导致市场开始调整，不过这些风险因素在二季度都得到边际改善，市场也有所反弹。成长赛道反弹幅度较大、估值又回高位，经济受疫情和房地产影响还比较疲弱，疫情风险依然存在。因此预计市场震荡整固可能性较大，行情继续分化，市场表现更有可能是中小市值风格。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术，建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方优质企业混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|-------|---------|---------------------|-----------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.3.1 | 65,148,254.34 | 96,746,311.78 |
| 结算备付金 | | 11,091,913.85 | 2,105,861.26 |
| 存出保证金 | | 322,776.15 | 472,145.41 |

| | | | |
|-----------|---------|---------------------|-----------------------|
| 交易性金融资产 | 6.4.3.2 | 1,004,097,893.91 | 1,125,111,837.72 |
| 其中：股票投资 | | 952,162,908.47 | 1,125,111,837.72 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 51,934,985.44 | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.3.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.3.4 | - | - |
| 债权投资 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | 5,012,631.35 | 14,308,514.20 |
| 应收股利 | | 39,901.96 | - |
| 应收申购款 | | 228,719.53 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.3.5 | - | 19,320.15 |
| 资产总计 | | 1,085,942,091.09 | 1,238,763,990.52 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.3.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 20,338,501.34 | 1,686,635.92 |
| 应付赎回款 | | 1,462,765.58 | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,254,300.95 | 1,609,066.37 |
| 应付托管费 | | 209,050.14 | 268,177.73 |
| 应付销售服务费 | | 63,676.21 | 81,117.57 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.3.6 | 801,230.76 | 1,352,878.48 |
| 负债合计 | | 24,129,524.98 | 4,997,876.07 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.3.7 | 1,147,414,546.37 | 1,224,214,743.90 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.3.8 | -85,601,980.26 | 9,551,370.55 |

| | | | |
|----------|--|------------------|------------------|
| 净资产合计 | | 1,061,812,566.11 | 1,233,766,114.45 |
| 负债和净资产总计 | | 1,085,942,091.09 | 1,238,763,990.52 |

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，南方优质企业混合 A 份额净值 0.9263 元，基金份额总额 1,001,411,113.99 份；南方优质企业混合 C 份额净值 0.9191 元，基金份额总额 146,003,432.38 份；总份额合计 1,147,414,546.37 份。

6.2 利润表

会计主体：南方优质企业混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 3 月 10 日（基金合同 生效日）至 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------------------------|----------|---------------------------------------|---|
| 一、营业总收入 | | -96,339,496.97 | 289,741,029.30 |
| 1.利息收入 | | 254,701.27 | 3,031,894.20 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.3.9 | 254,701.27 | 1,264,971.26 |
| 债券利息收入 | | - | 692.52 |
| 资产支持证券利息 收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产 收入 | | - | 1,766,230.42 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-” 填列） | | -80,392,591.87 | 20,908,694.92 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.3.10 | -84,785,213.73 | 8,540,432.14 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.3.11 | 606,611.66 | - |
| 资产支持证券投资 收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.3.12 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.3.13 | 3,786,010.20 | 12,368,262.78 |
| 以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列） | 6.4.3.14 | -16,263,588.79 | 263,818,681.27 |
| 4.汇兑收益（损失以“-” | | - | - |

| | | | |
|---------------------|-----------|-----------------|----------------|
| 号填列) | | | |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 6.4.3.15 | 61,982.42 | 1,981,758.91 |
| 减:二、营业总支出 | | 9,430,055.93 | 19,172,473.89 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.6.2.1 | 7,657,923.36 | 11,467,196.32 |
| 2.托管费 | 6.4.6.2.2 | 1,276,320.48 | 1,911,199.42 |
| 3.销售服务费 | 6.4.6.2.3 | 391,529.94 | 463,608.81 |
| 4.投资顾问费 | | - | - |
| 5.利息支出 | | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6.信用减值损失 | | - | - |
| 7.税金及附加 | | 0.78 | 0.12 |
| 8.其他费用 | 6.4.3.16 | 104,281.37 | 5,330,469.22 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | -105,769,552.90 | 270,568,555.41 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | -105,769,552.90 | 270,568,555.41 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -105,769,552.90 | 270,568,555.41 |

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体:南方优质企业混合型证券投资基金

本报告期:2022年1月1日至2022年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期2022年1月1日至2022年6月30日 | | | |
|----------------------|------------------------|--------|-----------------|------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 1,224,214,743.90 | - | 9,551,370.55 | 1,233,766,114.45 |
| 加:会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 1,224,214,743.90 | - | 9,551,370.55 | 1,233,766,114.45 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -76,800,197.53 | - | -95,153,350.81 | -171,953,548.34 |
| (一)、综合收益 | - | - | -105,769,552.90 | -105,769,552.90 |

| | | | | |
|--|---|--------|----------------|------------------|
| 总额 | | | | |
| (二)、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) | -76,800,197.53 | - | 10,616,202.09 | -66,183,995.44 |
| 其中: 1.基金申购款 | 34,227,106.93 | - | -4,252,975.09 | 29,974,131.84 |
| 2.基金赎回款 | -111,027,304.46 | - | 14,869,177.18 | -96,158,127.28 |
| (三)、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) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 1,147,414,546.37 | - | -85,601,980.26 | 1,061,812,566.11 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | - | - | - | - |
| 加: 会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 2,508,923,107.75 | - | - | 2,508,923,107.75 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -702,740,589.64 | - | 209,414,093.32 | -493,326,496.32 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 270,568,555.41 | 270,568,555.41 |
| (二)、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) | -702,740,589.64 | - | -61,154,462.09 | -763,895,051.73 |
| 其中: 1.基金申 | 65,491,195.40 | - | 5,349,993.96 | 70,841,189.36 |

| | | | | |
|--|------------------|---|----------------|------------------|
| 购款 | | | | |
| 2.基金赎回款 | -768,231,785.04 | - | -66,504,456.05 | -834,736,241.09 |
| (三)、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) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 1,806,182,518.11 | - | 209,414,093.32 | 2,015,596,611.43 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述会计政策外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.1.1 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以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”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计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

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。

6.4.1.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。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；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其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，但是未保留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。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。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。

6.4.1.3 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。

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与相关交易费用后的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。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。买卖债券价差收入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、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。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。买卖资产支持证券价差收入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、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

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、相关交易费用与税费后的差额确认。

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确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

(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。

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下简称“新金融工具准则”)相关规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会[2020]22 号),公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用新金融工具准则,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初基金净值,2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日,本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元,本基金执行新金融工具准则的影响如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、卖出回购金融资产款和应付利息,金额分别为人民币 96,746,311.78 元、人民币 2,105,861.26 元、人民币 472,145.41 元、人民币 0.00 元、人民币 19,320.15 元、人民币 0.00 元和人民币 0.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中,并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等项目中,不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下,银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息的金额分别为人民币 96,764,471.93 元、人民币 2,106,808.86 元、人民币 472,357.81 元、人民币 0.00 元、人民币 0.00 元、人民币 0.00 元和人民币 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产,金额为人民币 1,125,111,837.72 元,归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 0.00 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产,金额为人民币 1,125,111,837.72 元。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------|
| 活期存款 | 65,148,254.34 |
| 等于：本金 | 65,135,327.20 |
| 加：应计利息 | 12,927.14 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 65,148,254.34 |

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | | | | |
|---------------|---------------------|---------------|------------------|---------------|-----------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 896,887,505.65 | - | 952,162,908.47 | 55,275,402.82 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 51,252,988.10 | 606,107.44 | 51,934,985.44 | 75,889.90 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 51,252,988.10 | 606,107.44 | 51,934,985.44 | 75,889.90 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 948,140,493.75 | 606,107.44 | 1,004,097,893.91 | 55,351,292.72 | |

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 572.13 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 716,356.07 |
| 其中：交易所市场 | 716,356.07 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 84,302.56 |
| 其他 | - |
| 合计 | 801,230.76 |

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 南方优质企业混合 A | | |
|---------------|------------------------------------|------------------|
| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,067,447,908.28 | 1,067,447,908.28 |
| 本期申购 | 19,631,075.19 | 19,631,075.19 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -85,667,869.48 | -85,667,869.48 |
| 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 | 1,001,411,113.99 | 1,001,411,113.99 |

| 南方优质企业混合 C | | |
|----------------|------------------------------------|----------------|
| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额 (份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 156,766,835.62 | 156,766,835.62 |
| 本期申购 | 14,596,031.74 | 14,596,031.74 |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -25,359,434.98 | -25,359,434.98 |
| 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 | 146,003,432.38 | 146,003,432.38 |

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

| 南方优质企业混合 A | | | |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 本期期初 | 37,939,622.15 | -28,941,888.94 | 8,997,733.21 |
| 本期利润 | -77,711,975.80 | -14,079,385.08 | -91,791,360.88 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -213,662.72 | 9,220,318.04 | 9,006,655.32 |
| 其中：基金申购款 | 160,003.30 | -2,580,847.97 | -2,420,844.67 |
| 基金赎回款 | -373,666.02 | 11,801,166.01 | 11,427,499.99 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -39,986,016.37 | -33,800,955.98 | -73,786,972.35 |

| 南方优质企业混合 C | | | |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 本期期初 | 4,755,620.50 | -4,201,983.16 | 553,637.34 |
| 本期利润 | -11,793,988.31 | -2,184,203.71 | -13,978,192.02 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 143,972.90 | 1,465,573.87 | 1,609,546.77 |
| 其中：基金申购款 | 72,117.82 | -1,904,248.24 | -1,832,130.42 |
| 基金赎回款 | 71,855.08 | 3,369,822.11 | 3,441,677.19 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -6,894,394.91 | -4,920,613.00 | -11,815,007.91 |

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------|------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 240,546.54 |
| 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 | 11,068.11 |
| 其他 | 3,086.62 |
| 合计 | 254,701.27 |

6.4.3.10 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 719,171,420.96 |
| 减：卖出股票成本总额 | 801,786,887.61 |
| 减：交易费用 | 2,169,747.08 |
| 买卖股票差价收入 | -84,785,213.73 |

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.11 债券投资收益

6.4.3.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------------------------|------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 301,287.52 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 305,324.14 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 606,611.66 |

6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------------------|------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,343,608.80 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,038,000.00 |
| 减：应计利息总额 | 231.74 |
| 减：交易费用 | 52.92 |
| 买卖债券差价收入 | 305,324.14 |

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.3.12 衍生工具收益

6.4.3.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.3.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.3.13 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 3,786,010.20 |
| 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 | 3,786,010.20 |

6.4.3.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -16,263,588.79 |
| ——股票投资 | -16,339,478.69 |
| ——债券投资 | 75,889.90 |
| ——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 | -16,263,588.79 |

6.4.3.15 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 58,568.37 |
| 基金转换费收入 | 3,414.05 |
| 合计 | 61,982.42 |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，将不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------------------|
| 审计费用 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |

| | |
|---------|------------|
| 证券出借违约金 | - |
| 账户维护费 | 9,000.00 |
| 银行费用 | 10,686.80 |
| 其他 | 292.01 |
| 合计 | 104,281.37 |

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|---------------------|
| 南方基金管理股份有限公司(“南方基金”) | 基金管理人、注册登记机构、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”) | 基金管理人的股东华泰证券控制的公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2021 年 3 月 10 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 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 4,761,131.39 | 0.35% | 482,904,862.01 | 12.24% |

6.4.6.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 |
| 华泰证券 | 2,261.53 | 0.18% | 187.50 | 0.03% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2021 年 3 月 10 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 |
| 华泰证券 | 440,071.47 | 12.37% | - | - |

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。

6.4.6.2 关联方报酬**6.4.6.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 3 月 10 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 | 7,657,923.36 | 11,467,196.32 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,992,079.96 | 4,880,977.94 |

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×1.5%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×1.5%÷当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 3 月 10 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 | 1,276,320.48 | 1,911,199.42 |

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | |
|----------------|---|------------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 南方优质企业混合 A | 南方优质企业混合 C | 合计 |
| 华泰证券 | - | 28,258.16 | 28,258.16 |
| 南方基金 | - | 111,620.53 | 111,620.53 |
| 农业银行 | - | 25,514.68 | 25,514.68 |
| 兴业证券 | - | 456.69 | 456.69 |
| 合计 | - | 165,850.06 | 165,850.06 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2021 年 3 月 10 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 | | |
| | 南方优质企业混合 A | 南方优质企业混合 C | 合计 |
| 华泰证券 | - | 48,345.76 | 48,345.76 |
| 南方基金 | - | 146,139.93 | 146,139.93 |
| 农业银行 | - | 21,612.10 | 21,612.10 |
| 兴业证券 | - | 396.85 | 396.85 |
| 合计 | - | 216,494.64 | 216,494.64 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 X 0.60% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2021 年 3 月 10 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 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行 | 65,148,254.34 | 240,546.54 | 159,311,961.22 | 1,121,218.58 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

| 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 | 688046 | 药康生物 | 网下申购 | 12,070 | 271,937.10 |
| 华泰联合 | 301153 | 中科江南 | 网下申购 | 3,973 | 133,810.64 |
| 兴业证券 | 600030 | 中信证券 | 配股 | 156,255 | 2,254,759.65 |

| 上年度可比期间 2021 年 3 月 10 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 | 113050 | 南银转债 | 优先配售 | 93,970 | 9,397,000.00 |
| 华泰联合 | 605499 | 东鹏饮料 | 网下申购 | 632 | 29,242.64 |
| 华泰联合 | 688097 | 博众精工 | 网下申购 | 3,983 | 44,888.41 |
| 华泰联合 | 688161 | 威高骨科 | 网下申购 | 3,069 | 111,159.18 |
| 华泰联合 | 688314 | 康拓医疗 | 网下申购 | 1,085 | 18,813.90 |
| 华泰联合 | 688613 | 奥精医疗 | 网下申购 | 2,617 | 42,997.31 |
| 华泰联合 | 300975 | 商络电子 | 网下申购 | 4,917 | 26,945.16 |
| 兴业证券 | 688597 | 煜邦电力 | 网下申购 | 3,907 | 22,973.16 |
| 兴业证券 | 688639 | 华恒生物 | 网下申购 | 2,302 | 53,314.32 |
| 兴业证券 | 300979 | 华利集团 | 网下申购 | 9,246 | 307,152.12 |

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.7 利润分配情况**6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.8 期末（2022 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.8.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---------------------|------|-----------------|-----------|----------|--------|--------|----------|--------------|--------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 000155 | 川能动力 | 2022 年 1 月 13 日 | 6 个月 | 非公开发行锁定期 | 22.93 | 21.64 | 261,666 | 6,000,001.38 | 5,662,452.24 | - |
| 301109 | 军信股份 | 2022 年 4 月 6 日 | 6 个月 | 新股锁定期 | 34.81 | 16.14 | 1,225 | 42,642.25 | 19,771.50 | - |
| 301109 | 军信股份 | 2022 年 6 月 17 日 | 1-6 个月（含） | 锁定期转增 | - | 16.14 | 612 | - | 9,877.68 | - |
| 301150 | 中一科技 | 2022 年 4 月 14 日 | 6 个月 | 新股锁定期 | 163.56 | 82.76 | 269 | 43,997.64 | 22,262.44 | - |
| 301150 | 中一科技 | 2022 年 6 月 10 日 | 1-6 个月（含） | 锁定期转增 | - | 82.76 | 134 | - | 11,089.84 | - |
| 301153 | 中科江南 | 2022 年 5 月 10 日 | 6 个月 | 新股锁定期 | 33.68 | 43.98 | 398 | 13,404.64 | 17,504.04 | - |
| 301158 | 德石股份 | 2022 年 1 月 7 日 | 6 个月 | 新股锁定期 | 15.64 | 20.38 | 379 | 5,927.56 | 7,724.02 | - |
| 301181 | 标榜股份 | 2022 年 2 月 11 日 | 6 个月 | 新股锁定期 | 40.25 | 30.59 | 257 | 10,344.25 | 7,861.63 | - |
| 301196 | 唯科科技 | 2022 年 1 月 4 日 | 6 个月 | 新股锁定期 | 64.08 | 37.52 | 271 | 17,365.68 | 10,167.92 | - |
| 301217 | 铜冠铜箔 | 2022 年 1 月 20 日 | 6 个月 | 新股锁定期 | 17.27 | 14.83 | 3,467 | 59,875.09 | 51,415.61 | - |
| 301219 | 腾远钴业 | 2022 年 3 月 10 日 | 6 个月 | 新股锁定期 | 173.98 | 87.82 | 224 | 38,971.52 | 19,671.68 | - |
| 301219 | 腾远钴业 | 2022 | 1-6 个月 | 锁定期 | - | 87.82 | 179 | - | 15,719.78 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|-----------|-------|--------|--------|--------|------------|--------------|---|
| | | 年 5 月 24 日 | 月(含) | 转增 | | | | | | |
| 301238 | 瑞泰新材 | 2022 年 6 月 10 日 | 6 个月 | 新股锁定期 | 19.18 | 32.07 | 3,047 | 58,441.46 | 97,717.29 | - |
| 301248 | 杰创智能 | 2022 年 4 月 13 日 | 6 个月 | 新股锁定期 | 39.07 | 29.87 | 472 | 18,441.04 | 14,098.64 | - |
| 600938 | 中国海油 | 2022 年 4 月 14 日 | 6 个月 | 新股锁定期 | 10.80 | 15.86 | 84,004 | 907,243.20 | 1,332,303.44 | - |
| 688046 | 药康生物 | 2022 年 4 月 14 日 | 6 个月 | 新股锁定期 | 22.53 | 26.24 | 12,070 | 271,937.10 | 316,716.80 | - |
| 688281 | 华秦科技 | 2022 年 2 月 28 日 | 6 个月 | 新股锁定期 | 189.50 | 246.22 | 3,076 | 582,902.00 | 757,372.72 | - |
| 688281 | 华秦科技 | 2022 年 6 月 6 日 | 1-6 个月(含) | 锁定期转增 | - | 246.22 | 1,231 | - | 303,096.82 | - |

6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|------|------|-------|-----|--------|------|--------|----------|--------|--------|----|
| - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.9 金融工具风险及管理

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。

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期风险和收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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

6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.9.3 流动性风险

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

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

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 6 月 30 日,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时,基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度,按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度,根据质押

品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

本基金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、结算备付金和存出保证金等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022 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 | 65,148,254.34 | - | - | - | 65,148,254.34 |
| 结算备付金 | 11,091,913.85 | - | - | - | 11,091,913.85 |
| 存出保证金 | 322,776.15 | - | - | - | 322,776.15 |
| 交易性金融资产 | 51,934,985.44 | - | - | 952,162,908.47 | 1,004,097,893.91 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 债权投资 | - | - | - | - | - |
| 其他债权投资 | - | - | - | - | - |
| 其他权益工具投资 | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | 5,012,631.35 | 5,012,631.35 |

| | | | | | |
|-----------------------------|----------------|-------|-------|----------------|------------------|
| 应收股利 | - | - | - | 39,901.96 | 39,901.96 |
| 应收申购款 | 98,140.11 | - | - | 130,579.42 | 228,719.53 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 128,596,069.89 | - | - | 957,346,021.20 | 1,085,942,091.09 |
| 负债 | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付清算款 | - | - | - | 20,338,501.34 | 20,338,501.34 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,462,765.58 | 1,462,765.58 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,254,300.95 | 1,254,300.95 |
| 应付托管费 | - | - | - | 209,050.14 | 209,050.14 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 63,676.21 | 63,676.21 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 801,230.76 | 801,230.76 |
| 负债总计 | - | - | - | 24,129,524.98 | 24,129,524.98 |
| 利率敏感度缺口 | 128,596,069.89 | - | - | 933,216,496.22 | 1,061,812,566.11 |
| 上年度末 2021 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 | 96,746,311.78 | - | - | - | 96,746,311.78 |
| 结算备付金 | 2,105,861.26 | - | - | - | 2,105,861.26 |
| 存出保证金 | 472,145.41 | - | - | - | 472,145.41 |
| 交易性金融 | - | - | - | 1,125,111.83 | 1,125,111.83 |

| | | | | | |
|-----------|---------------|---|---|------------------|------------------|
| 资产 | | | | 7.72 | 7.72 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 债权投资 | - | - | - | - | - |
| 其他债权投资 | - | - | - | - | - |
| 其他权益工具投资 | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | 14,308,514.20 | 14,308,514.20 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | 19,320.15 | 19,320.15 |
| 资产总计 | 99,324,318.45 | - | - | 1,139,439,672.07 | 1,238,763,990.52 |
| 负债 | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付清算款 | - | - | - | 1,686,635.92 | 1,686,635.92 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,609,066.37 | 1,609,066.37 |
| 应付托管费 | - | - | - | 268,177.73 | 268,177.73 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 81,117.57 | 81,117.57 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 1,352,878.48 | 1,352,878.48 |
| 负债总计 | - | - | - | 4,997,876.07 | 4,997,876.07 |
| 利率敏感度 | 99,324,318.4 | - | - | 1,134,441.79 | 1,233,766.11 |

| | | | | |
|----|---|--|------|------|
| 缺口 | 5 | | 6.00 | 4.45 |
|----|---|--|------|------|

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元) | |
| | | 本期末(2022年6月30日) | 上年度末(2021年12月31日) |
| | 1.市场利率平行上升25个基点 | -57,959.05 | 0.00 |
| | 2.市场利率平行下降25个基点 | 58,170.06 | 0.00 |

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位:人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | | | | | 合计 |
|---------------|---------------------|---------------|---------|---------|-----------|---------------|
| | 美元折合人民币 | 港币折合人民币 | 欧元折合人民币 | 日元折合人民币 | 其他币种折合人民币 | |
| 以外币计价的资产 | | | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 63,120,462.16 | - | - | - | 63,120,462.16 |
| 资产合计 | - | 63,120,462.16 | - | - | - | 63,120,462.16 |
| 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 | - | 63,120,462.16 | - | - | - | 63,120,462.16 |

| 项目 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | | | | | 合计 |
|----|-----------------------|---------|---------|---------|-----------|----|
| | 美元折合人民币 | 港币折合人民币 | 欧元折合人民币 | 日元折合人民币 | 其他币种折合人民币 | |

| | | | | | | |
|---------------|---|--------------|---|---|---|--------------|
| 以外币计价的资产 | | | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 4,061,460.71 | - | - | - | 4,061,460.71 |
| 资产合计 | - | 4,061,460.71 | - | - | - | 4,061,460.71 |
| 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 | - | 4,061,460.71 | - | - | - | 4,061,460.71 |

6.4.9.4.2.2 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（2022年6月30日） | 上年度末（2021年12月31日） |
| | 1. 所有外币相对人民币升值 5% | 3,156,023.11 | 203,073.04 |
| 2. 所有外币相对人民币贬值 5% | -3,156,023.11 | -203,073.04 | |

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资（含存托凭证）占基金资产的比例范围为 60%-95%（其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%），其中投资于本基金定义的“优质企业”主题的证券不低于非现金基金资产的 80%。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。此外，本基金的基金管理人每日对

本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | |
|---------------|---------------------|--------------|-----------------------|--------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 952,162,908.47 | 89.67 | 1,125,111,837.72 | 91.19 |
| 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 | 952,162,908.47 | 89.67 | 1,125,111,837.72 | 91.19 |

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|-------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2022 年 6 月 30 日） | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |
| | 1. 沪深 300 上升 5% | 53,138,700.19 | 52,802,562.06 |
| | 2. 沪深 300 下降 5% | -53,138,700.19 | -52,802,562.06 |

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------|
|---------------|---------------------|

| | |
|------|------------------|
| 第一层次 | 943,486,084.38 |
| 第二层次 | 51,934,985.44 |
| 第三层次 | 8,676,824.09 |
| 合计 | 1,004,097,893.91 |

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

§ 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 | 952,162,908.47 | 87.68 |
| | 其中：股票 | 952,162,908.47 | 87.68 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 51,934,985.44 | 4.78 |
| | 其中：债券 | 51,934,985.44 | 4.78 |
| | 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 | 76,240,168.19 | 7.02 |
| 8 | 其他资产 | 5,604,028.99 | 0.52 |

| | | | |
|---|----|------------------|--------|
| 9 | 合计 | 1,085,942,091.09 | 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 63,120,462.16 元，占基金资产净值比例 5.94%。

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 | 14,023,340.08 | 1.32 |
| C | 制造业 | 743,497,857.56 | 70.02 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 24,882,464.24 | 2.34 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 60,450.38 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,057,940.00 | 0.10 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 13,067,356.92 | 1.23 |
| J | 金融业 | 46,055,059.10 | 4.34 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 12,135,653.00 | 1.14 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 30,257,517.60 | 2.85 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,004,807.43 | 0.38 |
| 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 | 889,042,446.31 | 83.73 |

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 | 19,074,286.04 | 1.80 |
| 材料 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 非必需消费 | 6,745,695.96 | 0.64 |
| 必需消费品 | 20,397,478.77 | 1.92 |
| 医疗保健 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 科技 | - | - |

| | | |
|------|---------------|------|
| 通讯 | 16,608,747.61 | 1.56 |
| 公用事业 | 294,253.78 | 0.03 |
| 房地产 | - | - |
| 政府 | - | - |
| 合计 | 63,120,462.16 | 5.94 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 44,700 | 91,411,500.00 | 8.61 |
| 2 | 002812 | 恩捷股份 | 198,413 | 49,692,535.85 | 4.68 |
| 3 | 002466 | 天齐锂业 | 318,845 | 39,791,856.00 | 3.75 |
| 4 | 300696 | 爱乐达 | 780,504 | 34,303,150.80 | 3.23 |
| 5 | 603259 | 药明康德 | 287,920 | 29,940,800.80 | 2.82 |
| 6 | 688598 | 金博股份 | 88,851 | 26,184,389.70 | 2.47 |
| 7 | 002460 | 赣锋锂业 | 169,400 | 25,189,780.00 | 2.37 |
| 8 | 000001 | 平安银行 | 1,631,000 | 24,432,380.00 | 2.30 |
| 9 | 300274 | 阳光电源 | 240,100 | 23,589,825.00 | 2.22 |
| 10 | 600487 | 亨通光电 | 1,613,200 | 23,455,928.00 | 2.21 |
| 11 | 688599 | 天合光能 | 352,888 | 23,025,942.00 | 2.17 |
| 12 | 300593 | 新雷能 | 524,680 | 21,779,466.80 | 2.05 |
| 13 | 000776 | 广发证券 | 1,156,293 | 21,622,679.10 | 2.04 |
| 14 | 600522 | 中天科技 | 909,900 | 21,018,690.00 | 1.98 |
| 15 | 600456 | 宝钛股份 | 353,100 | 20,974,140.00 | 1.98 |
| 16 | 603806 | 福斯特 | 316,848 | 20,759,880.96 | 1.96 |
| 17 | 600765 | 中航重机 | 639,900 | 20,591,982.00 | 1.94 |
| 18 | 00168 | 青岛啤酒股份 | 292,000 | 20,376,783.17 | 1.92 |
| 19 | 688122 | 西部超导 | 214,469 | 19,774,041.80 | 1.86 |
| 20 | 03800 | 协鑫科技 | 5,885,000 | 19,074,286.04 | 1.80 |
| 21 | 601985 | 中国核电 | 2,772,700 | 19,020,722.00 | 1.79 |
| 22 | 300750 | 宁德时代 | 34,800 | 18,583,200.00 | 1.75 |
| 23 | 000799 | 酒鬼酒 | 97,119 | 18,045,681.39 | 1.70 |
| 24 | 605117 | 德业股份 | 60,060 | 16,810,193.40 | 1.58 |
| 25 | 00700 | 腾讯控股 | 54,800 | 16,608,747.61 | 1.56 |
| 26 | 002531 | 天顺风能 | 997,000 | 16,440,530.00 | 1.55 |
| 27 | 601877 | 正泰电器 | 416,500 | 14,902,370.00 | 1.40 |
| 28 | 603456 | 九洲药业 | 284,800 | 14,724,160.00 | 1.39 |
| 29 | 688388 | 嘉元科技 | 169,464 | 14,382,409.68 | 1.35 |
| 30 | 002179 | 中航光电 | 213,060 | 13,490,959.20 | 1.27 |
| 31 | 002906 | 华阳集团 | 272,000 | 12,324,320.00 | 1.16 |

| | | | | | |
|----|--------|----------|---------|---------------|------|
| 32 | 601888 | 中国中免 | 52,100 | 12,135,653.00 | 1.14 |
| 33 | 600298 | 安琪酵母 | 237,200 | 11,563,500.00 | 1.09 |
| 34 | 000983 | 山西焦煤 | 771,776 | 10,334,080.64 | 0.97 |
| 35 | 002821 | 凯莱英 | 34,400 | 9,941,600.00 | 0.94 |
| 36 | 600346 | 恒力石化 | 444,600 | 9,887,904.00 | 0.93 |
| 37 | 002415 | 海康威视 | 239,800 | 8,680,760.00 | 0.82 |
| 38 | 600111 | 北方稀土 | 240,300 | 8,448,948.00 | 0.80 |
| 39 | 300363 | 博腾股份 | 107,800 | 8,407,322.00 | 0.79 |
| 40 | 300595 | 欧普康视 | 123,662 | 7,072,229.78 | 0.67 |
| 41 | 02331 | 李宁 | 108,500 | 6,745,695.96 | 0.64 |
| 42 | 600702 | 舍得酒业 | 33,000 | 6,731,670.00 | 0.63 |
| 43 | 836239 | 长虹能源 | 148,470 | 6,495,562.50 | 0.61 |
| 44 | 603613 | 国联股份 | 68,850 | 6,100,110.00 | 0.57 |
| 45 | 603659 | 璞泰来 | 71,800 | 6,059,920.00 | 0.57 |
| 46 | 300850 | 新强联 | 68,000 | 6,054,040.00 | 0.57 |
| 47 | 300438 | 鹏辉能源 | 95,400 | 5,862,330.00 | 0.55 |
| 48 | 600809 | 山西汾酒 | 17,600 | 5,716,480.00 | 0.54 |
| 49 | 000155 | 川能动力 | 261,666 | 5,662,452.24 | 0.53 |
| 50 | 300014 | 亿纬锂能 | 52,700 | 5,138,250.00 | 0.48 |
| 51 | 600660 | 福耀玻璃 | 119,600 | 5,000,476.00 | 0.47 |
| 52 | 835185 | 贝特瑞 | 60,073 | 4,966,835.64 | 0.47 |
| 53 | 601012 | 隆基绿能 | 65,300 | 4,350,939.00 | 0.41 |
| 54 | 688232 | 新点软件 | 114,767 | 4,317,534.54 | 0.41 |
| 55 | 300861 | 美畅股份 | 46,500 | 4,310,085.00 | 0.41 |
| 56 | 603588 | 高能环境 | 343,140 | 3,956,404.20 | 0.37 |
| 57 | 688390 | 固德威 | 11,205 | 3,507,277.05 | 0.33 |
| 58 | 300373 | 扬杰科技 | 44,800 | 3,192,000.00 | 0.30 |
| 59 | 688348 | 昱能科技 | 5,145 | 2,510,760.00 | 0.24 |
| 60 | 603279 | 景津装备 | 78,400 | 2,431,184.00 | 0.23 |
| 61 | 600188 | 兖矿能源 | 59,700 | 2,356,956.00 | 0.22 |
| 62 | 300496 | 中科创达 | 15,600 | 2,035,488.00 | 0.19 |
| 63 | 002318 | 久立特材 | 99,700 | 1,594,203.00 | 0.15 |
| 64 | 600938 | 中国海油 | 84,004 | 1,332,303.44 | 0.13 |
| 65 | 300395 | 菲利华 | 24,500 | 1,102,500.00 | 0.10 |
| 66 | 688281 | 华秦科技 | 4,307 | 1,060,469.54 | 0.10 |
| 67 | 603871 | 嘉友国际 | 62,600 | 1,057,940.00 | 0.10 |
| 68 | 688533 | 上声电子 | 12,118 | 865,709.92 | 0.08 |
| 69 | 688066 | 航天宏图 | 6,611 | 520,946.80 | 0.05 |
| 70 | 301150 | 中一科技 | 4,025 | 365,815.66 | 0.03 |
| 71 | 002920 | 德赛西威 | 2,400 | 355,200.00 | 0.03 |
| 72 | 688046 | 药康生物 | 12,070 | 316,716.80 | 0.03 |
| 73 | 00902 | 华能国际电力股份 | 88,000 | 294,253.78 | 0.03 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|--------|------------|------|
| 74 | 600886 | 国投电力 | 18,980 | 199,290.00 | 0.02 |
| 75 | 688125 | 安达智能 | 3,774 | 179,415.96 | 0.02 |
| 76 | 301238 | 瑞泰新材 | 3,047 | 97,717.29 | 0.01 |
| 77 | 688103 | 国力股份 | 1,595 | 81,536.40 | 0.01 |
| 78 | 301217 | 铜冠铜箔 | 3,467 | 51,415.61 | 0.00 |
| 79 | 301177 | 迪阿股份 | 614 | 45,558.80 | 0.00 |
| 80 | 688296 | 和达科技 | 1,658 | 43,522.50 | 0.00 |
| 81 | 601089 | 福元医药 | 1,749 | 36,816.45 | 0.00 |
| 82 | 301219 | 腾远钴业 | 403 | 35,391.46 | 0.00 |
| 83 | 301109 | 军信股份 | 1,837 | 29,649.18 | 0.00 |
| 84 | 603051 | 鹿山新材 | 272 | 21,488.00 | 0.00 |
| 85 | 06969 | 思摩尔国际 | 1,000 | 20,695.60 | 0.00 |
| 86 | 301127 | 天源环保 | 1,685 | 18,754.05 | 0.00 |
| 87 | 301221 | 光庭信息 | 280 | 18,152.40 | 0.00 |
| 88 | 301153 | 中科江南 | 398 | 17,504.04 | 0.00 |
| 89 | 301166 | 优宁维 | 253 | 14,891.58 | 0.00 |
| 90 | 301168 | 通灵股份 | 329 | 14,831.32 | 0.00 |
| 91 | 301248 | 杰创智能 | 472 | 14,098.64 | 0.00 |
| 92 | 688200 | 华峰测控 | 37 | 13,186.80 | 0.00 |
| 93 | 001268 | 联合精密 | 409 | 11,337.48 | 0.00 |
| 94 | 301196 | 唯科科技 | 271 | 10,167.92 | 0.00 |
| 95 | 301193 | 家联科技 | 297 | 8,063.55 | 0.00 |
| 96 | 301181 | 标榜股份 | 257 | 7,861.63 | 0.00 |
| 97 | 301158 | 德石股份 | 379 | 7,724.02 | 0.00 |

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------------|----------------|
| 1 | 000776 | 广发证券 | 31,171,927.58 | 2.53 |
| 2 | 601985 | 中国核电 | 23,966,194.51 | 1.94 |
| 3 | 002466 | 天齐锂业 | 23,573,508.00 | 1.91 |
| 4 | 688599 | 天合光能 | 22,044,921.53 | 1.79 |
| 5 | 300438 | 鹏辉能源 | 20,891,225.91 | 1.69 |
| 6 | 300274 | 阳光电源 | 20,629,751.00 | 1.67 |
| 7 | 00168 | 青岛啤酒股份 | 20,309,978.44 | 1.65 |
| 8 | 002555 | 三七互娱 | 20,212,400.53 | 1.64 |
| 9 | 03800 | 协鑫科技 | 18,006,791.17 | 1.46 |
| 10 | 002241 | 歌尔股份 | 17,413,447.00 | 1.41 |
| 11 | 002460 | 赣锋锂业 | 16,987,951.00 | 1.38 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 12 | 688598 | 金博股份 | 16,433,367.43 | 1.33 |
| 13 | 00700 | 腾讯控股 | 16,376,900.01 | 1.33 |
| 14 | 000983 | 山西焦煤 | 16,137,321.97 | 1.31 |
| 15 | 601877 | 正泰电器 | 14,718,724.00 | 1.19 |
| 16 | 605117 | 德业股份 | 14,023,534.20 | 1.14 |
| 17 | 603456 | 九洲药业 | 13,747,999.00 | 1.11 |
| 18 | 002179 | 中航光电 | 13,112,157.40 | 1.06 |
| 19 | 600346 | 恒力石化 | 12,893,999.00 | 1.05 |
| 20 | 002821 | 凯莱英 | 12,101,912.00 | 0.98 |

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 601012 | 隆基绿能 | 35,148,762.35 | 2.85 |
| 2 | 688598 | 金博股份 | 27,887,445.89 | 2.26 |
| 3 | 300775 | 三角防务 | 27,439,432.38 | 2.22 |
| 4 | 600030 | 中信证券 | 23,347,380.65 | 1.89 |
| 5 | 002241 | 歌尔股份 | 21,520,573.00 | 1.74 |
| 6 | 300750 | 宁德时代 | 21,277,770.00 | 1.72 |
| 7 | 688116 | 天奈科技 | 20,837,508.86 | 1.69 |
| 8 | 600585 | 海螺水泥 | 20,050,928.00 | 1.63 |
| 9 | 600036 | 招商银行 | 19,009,785.00 | 1.54 |
| 10 | 002555 | 三七互娱 | 18,554,160.99 | 1.50 |
| 11 | 600188 | 兖矿能源 | 18,530,450.00 | 1.50 |
| 12 | 600487 | 亨通光电 | 18,411,607.49 | 1.49 |
| 13 | 300438 | 鹏辉能源 | 17,630,173.60 | 1.43 |
| 14 | 600383 | 金地集团 | 14,292,244.00 | 1.16 |
| 15 | 688733 | 壹石通 | 13,330,535.43 | 1.08 |
| 16 | 300595 | 欧普康视 | 12,291,248.92 | 1.00 |
| 17 | 002484 | 江海股份 | 11,839,487.00 | 0.96 |
| 18 | 688388 | 嘉元科技 | 11,728,655.56 | 0.95 |
| 19 | 300569 | 天能重工 | 11,497,716.30 | 0.93 |
| 20 | 600886 | 国投电力 | 11,407,225.00 | 0.92 |

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 | 645,177,437.05 |
|--------------|----------------|

| | |
|--------------|----------------|
| 卖出股票收入（成交）总额 | 719,171,420.96 |
|--------------|----------------|

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 | 51,934,985.44 | 4.89 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 51,934,985.44 | 4.89 |

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 | 019666 | 22 国债 01 | 306,810 | 31,025,341.69 | 2.92 |
| 2 | 019664 | 21 国债 16 | 205,710 | 20,909,643.75 | 1.97 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货合约。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

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 | 322,776.15 |
| 2 | 应收清算款 | 5,012,631.35 |
| 3 | 应收股利 | 39,901.96 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 228,719.53 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |

| | | |
|---|----|--------------|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,604,028.99 |

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 |
| 南方优质企业混合 A | 20,716 | 48,339.98 | 2,608,091.91 | 0.26% | 998,803,022.08 | 99.74% |
| 南方优质企业混合 C | 5,910 | 24,704.47 | 682,051.69 | 0.47% | 145,321,380.69 | 99.53% |
| 合计 | 26,626 | 43,093.76 | 3,290,143.60 | 0.29% | 1,144,124,402.77 | 99.71% |

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 | 南方优质企业混合 A | 1,001,978.37 | 0.1001% |
| | 南方优质企业混合 C | 9.20 | 0.0000% |
| | 合计 | 1,001,987.57 | 0.0873% |

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 | 南方优质企业混合 A | 50~100 |
| | 南方优质企业混合 C | 0 |
| | 合计 | 50~100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 南方优质企业混合 A | 0 |
| | 南方优质企业混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 南方优质企业混合 A | 南方优质企业混合 C |
|----------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2021年3月10日)基金份额总额 | 2,257,902,228.81 | 251,020,878.94 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,067,447,908.28 | 156,766,835.62 |
| 本报告期基金总申购份额 | 19,631,075.19 | 14,596,031.74 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 85,667,869.48 | 25,359,434.98 |
| 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 | 1,001,411,113.99 | 146,003,432.38 |

§ 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

2022年5月27日，周易先生任南方基金管理股份有限公司董事长（法定代表人）。

2022年3月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022年3月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

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，基金管理人收到中国证券监督管理委员会深圳监管局对公司的监管措施。基金管理人已及时按要求改正并报告。

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 | |
| 江海证券 | 1 | 317,525,345.46 | 23.57% | 290,304.10 | 23.65% | - |
| 国泰君安 | 1 | 316,430,661.65 | 23.49% | 287,560.59 | 23.43% | - |
| 中泰证券 | 1 | 240,233,262.38 | 17.83% | 219,673.76 | 17.90% | - |
| 招商证券 | 1 | 174,401,112.71 | 12.94% | 159,574.67 | 13.00% | - |
| 东方证券 | 1 | 133,045,234.30 | 9.87% | 121,007.08 | 9.86% | - |
| 瑞银证券 | 1 | 87,544,154.83 | 6.50% | 79,632.42 | 6.49% | - |
| 开源证券 | 1 | 73,392,135.03 | 5.45% | 67,555.83 | 5.50% | - |
| 华泰证券 | 2 | 4,761,131.39 | 0.35% | 2,261.53 | 0.18% | - |
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中天证券 | 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。

C: 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

新增交易单元:

无

退租交易单元:

无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|---------------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 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 |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 52,596,596.90 | 100.00% | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中天证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资 | 证券时报、基金管理 | 2022-01-01 |

| | | | |
|---|--|----------------------------|------------|
| | 关联方承销证券的关联交易公告 | 人网站、中国证监会基金电子披露网站 | |
| 2 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金获配川能动力（000155）非公开发行 A 股的公告 | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-17 |
| 3 | 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 | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-18 |
| 4 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金参与中信证券股份有限公司配股的关联交易公告 | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-28 |
| 5 | 南方基金关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构及开通相关业务的公告 | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-10 |
| 6 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告 | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-16 |
| 7 | 关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告 | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-22 |
| 8 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告 | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-05-12 |
| 9 | 南方基金关于旗下部分基金增加中欧财富为销售机构及开通相关业务的公告 | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-06-27 |

§ 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优质企业混合型证券投资基金的文件；

- 2、《南方优质企业混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方优质企业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、《南方优质企业混合型证券投资基金 2022 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>