

南方浩睿进取京选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	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 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48

7.12	本报告期投资基金情况.....	48
7.13	投资组合报告附注.....	52
§8	基金份额持有人信息.....	53
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	54
§9	开放式基金份额变动.....	54
§10	重大事件揭示.....	54
10.1	基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4	基金投资策略的改变.....	55
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	55
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.9	其他重大事件.....	57
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12	备查文件目录.....	57
12.1	备查文件目录.....	57
12.2	存放地点.....	58
12.3	查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方浩睿进取京选3个月持有期混合型基金中基金(FOF)	
基金简称	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)	
基金主代码	011696	
交易代码	011696	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年4月20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	
报告期末基金份额总额	772,717,547.19份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)A	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)C
下属分级基金的交易代码	011696	011697
报告期末下属分级基金的份额总额	754,926,666.57份	17,790,880.62份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金是基金中基金，优选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。本基金的主要投资策略为基金投资策略，本基金在开放式基金投资方面，基于南方基金基金评价系统对全市场基金公司及其管理的基金的评级，将力求投资于管理规范、业绩优良的基金管理公司的基金，以分享资本市场的成长。
业绩比较基准	万得偏股混合型基金指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%
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。

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	招商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	常克川	张燕
	联系电话	0755-82763888	0755-83199084
	电子邮箱	manager@southernfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95555
传真		0755-82763889	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518017	518040
法定代表人		周易	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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）

2.5 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、南方浩睿进取京选 3 个月持有混合（FOF）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	-80,152,438.20
本期利润	-96,354,891.03
加权平均基金份额本期利润	-0.1235
本期加权平均净值利润率	-14.16%
本期基金份额净值增长率	-11.64%
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	-102,269,389.18

期末可供分配基金份额利润	-0.1355
期末基金资产净值	667,999,349.54
期末基金份额净值	0.8849
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	-11.51%

2、南方浩睿进取京选 3 个月持有混合 (FOF) 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	-1,899,760.77
本期利润	-2,271,317.83
加权平均基金份额本期利润	-0.1242
本期加权平均净值利润率	-14.29%
本期基金份额净值增长率	-11.83%
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	-2,482,729.42
期末可供分配基金份额利润	-0.1396
期末基金资产净值	15,667,248.22
期末基金份额净值	0.8806
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	-11.94%

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。

4、本基金 T 日的基金份额净值在所投资基金披露净值或万份收益的当日（法定节假日顺延至第一个交易日）计算，并于 T+3 日公告。

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

南方浩睿进取京选 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
过去一个月	5.89%	0.85%	9.13%	1.02%	-3.24%	-0.17%
过去三个月	3.72%	1.22%	7.42%	1.30%	-3.70%	-0.08%
过去六个月	-11.64%	1.27%	-8.73%	1.29%	-2.91%	-0.02%

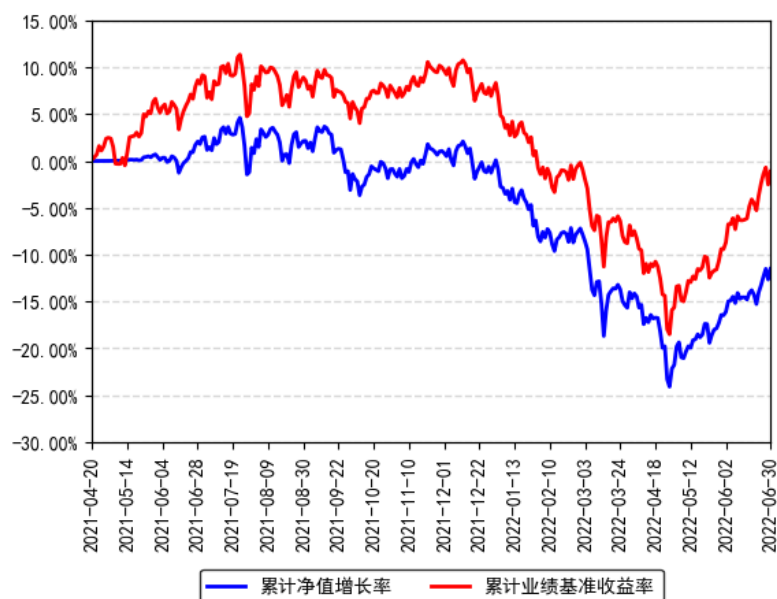
过去一年	-13.69%	1.09%	-9.43%	1.12%	-4.26%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-11.51%	1.01%	-1.12%	1.08%	-10.39%	-0.07%

南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)C

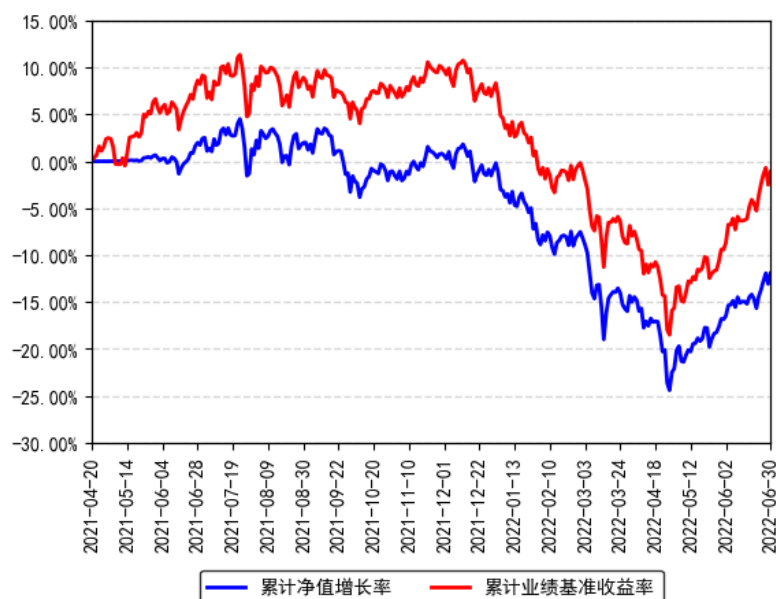
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.84%	0.84%	9.13%	1.02%	-3.29%	-0.18%
过去三个月	3.60%	1.22%	7.42%	1.30%	-3.82%	-0.08%
过去六个月	-11.83%	1.27%	-8.73%	1.29%	-3.10%	-0.02%
过去一年	-14.04%	1.09%	-9.43%	1.12%	-4.61%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-11.94%	1.01%	-1.12%	1.08%	-10.82%	-0.07%

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

南方浩睿进取京选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



南方浩睿进取京选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		
夏莹莹	本基金基金经理	2021年4月20日	-	16年	女，香港科技大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾先后就职于晨星资讯投资管理部、招商银行私人银行部、腾讯支付基础平台与金融应用线金融合作和政策部，历任投资顾问、高级分析师、金融产品高级经理。2017年3月加入南方基金，任宏观研究与资产配置部高级研究员。2017年11月10日至今，任南方全天候策略基金经理；2019年1月17日至今，任南方合顺多资产基金经理；2021年4月20日至今，任南方浩睿进取京选3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

年初以来,全球各类资产呈现较大波动。总体来看,影响市场大幅波动的因素主要包括三个方面:首先,二月底以来俄乌危机升级令本来就处于历史高位的原油、天然气、煤炭等资源品价格进一步走高;其次,在高通胀的压力下,美联储开启加息缩表,10年期美债收益率一路走高,并在6月中旬达到接近3.5%的水平。受美债收益率大幅上行以及投资者对于美国陷入经济衰退的担忧上升,美股承压;而美元持续创新高也进一步压制黄金表现。国内方面,一季度因多个一线城市封城,导致经济表现不佳,国内股票在国内外多重因素压制下大幅下挫。随着疫情逐渐得到有效控制,生产和经营活动恢复,并且在国内较为宽松流动性支持下A股在二季度反弹幅度较大。具体来看,上半年,国内市场方面偏大盘蓝筹的上证50和沪深300分别下跌6.59%和9.22%,创业板和中证500分别下跌15.41%和12.3%,恒生指数下跌6.6%;海外市场方面,标普500和纳斯达克指数分别下跌20.6%和29.5%,MSCI新兴市场下跌18.8%;大宗商品方面,原油上涨47.7%,黄金下跌1.1%。

南方浩睿进取在一季度相较于业绩基准有一定超额收益。组合在一季度整体股票仓位穿透以后平均约为77%-80%,较去年底有明显下降。组合一季度增加了偏低估值、价值风格基金配置比例,并且降低偏成长风格基金占比,总体来看,组合配置上均衡略偏价值。随着疫情逐渐得到控制,组合自5月初开始逐渐增加偏成长和均衡成长风格基金配置,并且穿透以后股票仓位上也较一季度有大约5%左右抬升。整体配置结构较为均衡。由于新能源相关行业在二季度涨幅较大,组合整体在穿透以后对于新能源的配置比例相对较少,因此在二季度组合未能跑赢业绩基准。

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0.8849元,报告期内,份额净值增长率为-11.64%,同期业绩基准增长率为-8.73%;本基金C份额净值为0.8806元,报告期内,份额净值增长率为-11.83%,同期业绩基准增长率为-8.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于A股市场,中长期我们仍然保持乐观态度。首先,中国仍是全球较少数具有较好经济活力的经济体。其次,中国人民的财富增长和财富转移,以及国内经济的转型升级都为A

股中长期发展提供了较好的潜在增长动力。此外，政策层面来看也是鼓励资本市场稳健有序的长期发展。

自四月底以来，A股独立于海外市场，出现了较大幅度反弹。截止6月30日，上证综指从4月27日底部反弹16.05%，偏成长的创业板和中证1000指数反弹幅度超过30%，偏大盘蓝筹的上证50和沪深300指数分别反弹14.08%和18.52%。行业层面来看，受益于上海疫情得到控制，复工复产有序展开、行业景气度较高的电气设备、汽车和有色金属期间涨幅最大，分别上涨54.11%、46.04%和36.1%。银行和地产表现较为落后。

回头来看，本轮反弹有几方面因素：首先，上海疫情在4月底逐渐得到控制并于6月开始全面复工复产，前期疫情影响下的悲观情绪有所化解；其次，政策层面来看，逐渐释放出关于支持经济发展、支持消费及新能源车等相关利好政策；此外，地产销售数据自五月份以来回暖较为明显，也一定程度上化解了市场对于地产的担忧。最后，从流动性层面来看，尽管美债收益率在6月中旬一度上升至3.5%附近，但并未给A股带来明显压力，主要原因还是在于国内流动性较为充裕，资金利率一直维持在较低水平；而另一方面，北上资金四月底以来持续保持净流入状态。总体来看，本轮反弹的幅度和力度都较为超市场预期。反弹至此，从估值层面来看，股债风险溢价相较于4月份的高点有一定收敛，但仍然处于一倍标准差位置，股票估值仍然合理，具有配置吸引力。从风格维度来看，当前成长风格占优，而大小市值无明显差异，整体较为均衡。

由于近期市场反弹力度大且较为超预期，随着上市公司二季报及半年报数据陆续出炉，部分个股或板块存在因业绩不达预期而出现急速回调的可能性。此外，随着7月初金融数据和上市公司业绩陆续公布，市场将重新评估各项政策落地效果以及经济改善情况，此时市场可能面临较大波动。对于海外市场我们保持警惕，由于美国通胀依旧处于高位，市场对于美联储是否能够软着陆产生越来越多的怀疑，近期市场对于美国经济进入衰退的担忧明显抬升。在通胀居高不下的情况下，预计年内美联储将加速紧缩，加快转向。年内继续加息的幅度有可能达到175bps，最可能的路径是7月加息75bps，9月加息50bps，11月加息25bps，12月加息25bps。在此影响下，美国经济进入衰退或难以避免，美股盈利可能面临下调压力，从而是美股可能在三季度面临较大压力。历史上来看，美股回调时A股难有较好表现。但另一方面，自2020年以来，国内和美国的经济周期和货币周期错配，国内整体领先美国1年，当前经济仍然较弱的背景下，货币政策仍将维持偏宽松，稳增长下财政政策也将继续发力。随着国内疫情常态化管理，生产和生活将有序恢复，预计市场即便回调，整体幅度可控。因此总体认为市场在反弹后上行空间有待观察，下行风险可控，整体维持区间震荡。

配置结构层面，在当前经济趋弱，稳增长诉求仍在，稳增长链条上的建筑、建材、大金融以及地产等仍然将是全年主线；新能源、高端制造等符合中国制造业转型升级方向，因此在中长期具备较高配置价值。对于周期板块，供需矛盾或令大宗商品价格仍然维持高位，但需要注意的是考虑到全球经济进入衰退的风险上升，周期板块的波动可能会随之加大。对

于消费板块，总体认为随着疫情缓解，国门逐步放开，叠加各项稳消费稳就业政策出台，大消费有望逐渐恢复。总体来看，对于后期市场表现保持中性，组合将维持较为均衡的配置结构。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方浩睿进取京选3个月持有期混合型基金中基金(FOF)

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	3,786,498.84	7,242,384.21
结算备付金		94,861.91	226,269.04
存出保证金		53,802.40	58,428.30
交易性金融资产	6.4.3.2	681,454,520.39	830,367,346.32
其中：股票投资		15,677,311.50	57,206,564.97
基金投资		631,409,381.19	728,199,842.85
债券投资		34,367,827.70	44,960,938.50
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		1,000,000.00	1,071,207.21
应收股利		0.33	0.38
应收申购款		100,502.09	20,340.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	5,632.26	789,661.96
资产总计		686,495,818.22	839,775,637.51
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		746,345.83	-
应付赎回款		1,328,202.00	3,036,477.29
应付管理人报酬		519,810.52	698,788.24
应付托管费		92,217.28	107,547.30
应付销售服务费		4,944.83	6,613.74
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	137,700.00	201,447.29
负债合计		2,829,220.46	4,050,873.86
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	772,717,547.19	834,540,168.96
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	-89,050,949.43	1,184,594.69
净资产合计		683,666,597.76	835,724,763.65
负债和净资产总计		686,495,818.22	839,775,637.51

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，南方浩睿进取京选 3 个月持有混合（FOF）A 份额净值 0.8849 元，基金份额总额 754,926,666.57 份；南方浩睿进取京选 3 个月持有混合（FOF）C 份额净值 0.8806 元，基金份额总额 17,790,880.62 份；总份额合计 772,717,547.19 份。

6.2 利润表

会计主体：南方浩睿进取京选 3 个月持有期混合型证券投资基金(FOF)

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4月20日(基金合同 生效日)至2021年6月 30日
一、营业总收入		-94,619,789.08	30,343,557.61
1.利息收入		22,411.23	619,460.98
其中：存款利息收入	6.4.3.9	22,411.23	137,873.83
债券利息收入		-	230,263.53
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	251,323.62
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-” 填列)		-78,158,473.80	2,783,042.45
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-1,988,277.96	-450,147.12
基金投资收益	6.4.3.11	-79,717,263.95	1,343,278.62
债券投资收益	6.4.3.12	353,099.60	-
资产支持证券投资 收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	3,193,968.51	1,889,910.95
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)	6.4.3.17	-16,574,009.89	26,919,414.71
4.汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.3.18	90,283.38	21,639.47
减：二、营业总支出		4,006,419.78	2,134,139.31
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	3,310,454.81	1,578,448.02
2.托管费	6.4.6.2.2	562,198.44	357,738.96
3.销售服务费	6.4.6.2.3	31,627.93	18,373.39
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		-	549.65
8.其他费用	6.4.3.20	102,138.60	179,029.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-98,626,208.86	28,209,418.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-98,626,208.86	28,209,418.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-98,626,208.86	28,209,418.30

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方浩睿进取京选3个月持有期混合型基金中基金(FOF)

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）	834,540,168.96	-	1,184,594.69	835,724,763.65
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）	834,540,168.96	-	1,184,594.69	835,724,763.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-61,822,621.77	-	-90,235,544.12	-152,058,165.89
（一）、综合收益总额	-	-	-98,626,208.86	-98,626,208.86
（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）	-61,822,621.77	-	8,390,664.74	-53,431,957.03
其中：1.基金申购款	5,423,581.88	-	-758,349.46	4,665,232.42
2.基金赎回款	-67,246,203.65	-	9,149,014.20	-58,097,189.45
（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)	772,717,547.19	-	-89,050,949.43	683,666,597.76
项目	上年度可比期间 2021 年 4 月 20 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)	1,118,856,791.55	-	-	1,118,856,791.55
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,251,388.17	-	28,216,365.50	30,467,753.67
(一)、综合收益总额	-	-	28,209,418.30	28,209,418.30
(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)	2,251,388.17	-	6,947.20	2,258,335.37
其中: 1.基金申购款	2,251,388.17	-	6,947.20	2,258,335.37
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)	1,121,108,179.72	-	28,216,365.50	1,149,324,545.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

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

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。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

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类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。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的

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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具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在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于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；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于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;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然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的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

6.4.1.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允

价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《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》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，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。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告

和中期报告》》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度可比期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款、应收股利、应收申购款和其他资产-其他应收款，金额分别为 7,242,384.21 元、226,269.04 元、58,428.30 元、780,640.72 元、1,071,207.21 元、0.38 元、20,340.09 元和 9,021.24 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款、应收股利、应收申购款和其他资产-其他应收款，金额分别为 7,243,486.77 元、226,381.02 元、58,457.23 元、0.00 元、1,071,207.21 元、0.38 元、20,340.09 元和 9,021.24 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资产为交易性金融资产，金额为 830,367,346.32 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资产为交易性金融资产，金额为 831,146,743.57 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,036,477.29 元、698,788.24 元、107,547.30 元、6,613.74 元、100,094.28 元和 11,353.01 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,036,477.29 元、698,788.24 元、107,547.30 元、6,613.74 元、100,094.28 元和 11,353.01 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则

下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.2.2 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。

6.4.2.3 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。

6.4.3 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	3,786,498.84
等于：本金	3,785,964.60
加：应计利息	534.24
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	3,786,498.84

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		15,181,576.3 3	-	15,677,311.5 0	495,735.17
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	33,903,942.4 0	487,134.70	34,367,827.7 0	-23,249.40
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	33,903,942.4 0	487,134.70	34,367,827.7 0	-23,249.40
资产支持证券		-	-	-	-
基金		612,656,410. 59	-	631,409,381. 19	18,752,970.6 0
其他		-	-	-	-
合计		661,741,929. 32	487,134.70	681,454,520. 39	19,225,456.3 7

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	5,632.26
待摊费用	-
合计	5,632.26

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	138.22
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	43,342.23
其中：交易所市场	43,342.23
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,219.55
其他	-
合计	137,700.00

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方浩睿进取京选3个月持有混合（FOF）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	815,464,318.93	815,464,318.93
本期申购	4,455,814.46	4,455,814.46
本期赎回（以“-”号填列）	-64,993,466.82	-64,993,466.82
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	754,926,666.57	754,926,666.57

南方浩睿进取京选3个月持有混合（FOF）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	19,075,850.03	19,075,850.03
本期申购	967,767.42	967,767.42
本期赎回（以“-”号填列）	-2,252,736.83	-2,252,736.83
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	17,790,880.62	17,790,880.62

注：

申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-26,688,425.19	27,898,054.42	1,209,629.23
本期利润	-80,152,438.20	-16,202,452.83	-96,354,891.03

本期基金份额交易产生的变动数	4,571,474.21	3,646,470.56	8,217,944.77
其中：基金申购款	-464,811.27	-182,521.80	-647,333.07
基金赎回款	5,036,285.48	3,828,992.36	8,865,277.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-102,269,389.18	15,342,072.15	-86,927,317.03

南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-676,568.90	651,534.36	-25,034.54
本期利润	-1,899,760.77	-371,557.06	-2,271,317.83
本期基金份额交易产生的变动数	93,600.25	79,119.72	172,719.97
其中：基金申购款	-85,057.58	-25,958.81	-111,016.39
基金赎回款	178,657.83	105,078.53	283,736.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,482,729.42	359,097.02	-2,123,632.40

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	20,561.51
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	1,196.65
其他	653.07
合计	22,411.23

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	68,907,728.98
减：卖出股票成本总额	70,726,365.56
减：交易费用	169,641.38
买卖股票差价收入	-1,988,277.96

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 基金投资收益

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/赎回基金成交总额	440,608,788.22
减：卖出/赎回基金成本总额	519,409,718.58
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-

减：交易费用	916,333.59
基金投资收益	-79,717,263.95

注：上述交易费用（如有）包含基金买卖或申赎产生的交易费用。

6.4.3.12 债券投资收益

6.4.3.12.1 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	420,336.84
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-67,237.24
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	353,099.60

6.4.3.12.2 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	44,429,336.06
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	43,475,400.00
减：应计利息总额	1,021,140.26
减：交易费用	33.04
买卖债券差价收入	-67,237.24

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.3.13 资产支持证券投资收益

6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.3.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.3.15 衍生工具收益

6.4.3.15.1 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。

6.4.3.15.2 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。

6.4.3.16 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	465,537.53
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	2,728,430.98
合计	3,193,968.51

6.4.3.17 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	-16,574,009.89
——股票投资	-3,745,631.39
——债券投资	89,772.10
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-12,918,150.60
——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	-16,574,009.89

6.4.3.18 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	48,693.84
基金销售服务费返还收入	41,589.54
合计	90,283.38

注：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。

6.4.3.19 持有基金产生的费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	711,274.36
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	4,217,356.49
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	677,682.77

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.3.20 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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	7,919.05
合计	102,138.60

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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

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 4 月 20 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	62,161,066.81	61.71%	95,490,597.87	86.32%

6.4.6.1.2 基金交易

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 4 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2021 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
华泰证券	100,933,796.35	74.36%	334,055,389.30	87.16%

6.4.6.1.3 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。

6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	56,796.06	61.67%	27,056.88	62.43%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 4 月 20 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	87,021.38	86.32%	87,021.38	86.32%

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 4 月 20 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	3,310,454.81	1,578,448.02
其中：支付销售机构的客户维护费	1,711,812.85	1,077,886.47

注：

1. 本基金投资于基金管理人管理的其他基金部分不收取管理费。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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额 × 1.00% / 当年天数。

6.4.6.2 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 4 月 20 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	562,198.44	357,738.96

注：

1. 本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额 × 0.20% / 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		
	南方浩睿进取京选3个月持有混合（FOF）A	南方浩睿进取京选3个月持有混合（FOF）C	合计
南方基金	-	8,472.72	8,472.72
招商银行	-	11,314.68	11,314.68
合计	-	19,787.40	19,787.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 4 月 20 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		
	南方浩睿进取京选3个月持有混合（FOF）A	南方浩睿进取京选3个月持有混合（FOF）C	合计
南方基金	-	4,189.74	4,189.74
招商银行	-	6,939.06	6,939.06
合计	-	11,128.80	11,128.80

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% / 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 4 月 20 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
招商银行	3,786,498.84	20,561.51	56,901,984.09	121,198.23

注：本基金由基金托管人招商银行保管的银行存款，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	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2021 年 4 月 20 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	9,450	945,000.00

华泰联合	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
------	--------	------	------	-------	------------

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

于2022年06月30日，本基金持有基金管理人南方基金所管理的公开募集证券投资基金，成本总额为人民币30,595,042.79元，估值总额为人民币31,805,958.20元，占本基金基金资产净值的比例为4.65%（于2021年12月31日，本基金持有基金管理人南方基金所管理的公开募集证券投资基金，成本总额为人民币33,931,433.06元，估值总额为人民币31,991,797.30元，占本基金基金资产净值的比例为3.83%）。

6.4.6.8.2 当期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

项目	本期费用 2022年1月1日至 2022年6月30日	上年度可比期间 2021年4月 20日至2021年6月30日
当期交易基金产生的申购费 (元)	-	-
当期交易基金产生的赎回费 (元)	49,446.63	-
当期持有基金产生的应支付 销售服务费(元)	41,589.54	21,600.97
当期持有基金产生的应支付 管理费(元)	212,438.47	243,637.19
当期持有基金产生的应支付 托管费(元)	34,181.91	63,623.59

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金(ETF除外)，应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费(按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外)、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为0，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

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
600956	新天绿能	2022年1月7日	6个月	非公开发行锁定期	13.63	12.20	73,367	999,992.21	895,077.40	-
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**6.4.9.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为基金中基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资和债券投资等。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招商银行，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，在场外申赎基金份额均通过该基金的基金管理人的直销柜台办理，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。

本基金基于内部评价系统对基金管理公司及其管理基金的评级，将投资于管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的基金。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于锁定期届满后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自基金合同生效日满 3 个月起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、流通受限限制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,其余亦可在基金销售机构申购、赎回,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。在本基金开放日,本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的10%;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自基金合同生效日满3个月起对基金组合资产中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。

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、存出保证金和债券投资等。

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	3,786,498.84	-	-	-	3,786,498.84
结算备付金	94,861.91	-	-	-	94,861.91
存出保证金	53,802.40	-	-	-	53,802.40
交易性金融 资产	34,367,827.7 0	-	-	647,086,692. 69	681,454,520. 39
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	-	-	-	1,000,000.00	1,000,000.00
应收股利	-	-	-	0.33	0.33
应收申购款	10,179.95	-	-	90,322.14	100,502.09
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	5,632.26	5,632.26
资产总计	38,313,170.8 0	-	-	648,182,647. 42	686,495,818. 22
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	-	-	-	746,345.83	746,345.83

应付赎回款	-	-	-	1,328,202.00	1,328,202.00
应付管理人报酬	-	-	-	519,810.52	519,810.52
应付托管费	-	-	-	92,217.28	92,217.28
应付销售服务费	-	-	-	4,944.83	4,944.83
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	-	-	-	137,700.00	137,700.00
负债总计	-	-	-	2,829,220.46	2,829,220.46
利率敏感度缺口	38,313,170.80	-	-	645,353,426.96	683,666,597.76
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	7,242,384.21	-	-	-	7,242,384.21
结算备付金	226,269.04	-	-	-	226,269.04
存出保证金	58,428.30	-	-	-	58,428.30
交易性金融资产	44,609,600.00	-	351,338.50	785,406,407.82	830,367,346.32
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	-	-	-	1,071,207.21	1,071,207.21
应收股利	-	-	-	0.38	0.38
应收申购款	3,584.93	-	-	16,755.16	20,340.09
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	789,661.96	789,661.96
资产总计	52,140,266.48	-	351,338.50	787,284,032.53	839,775,637.51
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,036,477.29	3,036,477.29
应付管理人报酬	-	-	-	698,788.24	698,788.24
应付托管费	-	-	-	107,547.30	107,547.30
应付销售服务费	-	-	-	6,613.74	6,613.74
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	-	-	-	201,447.29	201,447.29
负债总计	-	-	-	4,050,873.86	4,050,873.86
利率敏感度缺口	52,140,266.48	-	351,338.50	783,233,158.67	835,724,763.65

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	-30,446.87	-34,492.60
2.市场利率平行下降25个基点	30,558.67	34,673.53	

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以宏观经济分析为重点，基于经济结构调整过程中相关政策与法规的变化、证券市场环境、金融市场利率变化、经济运行周期、投资者情绪以及证券市场不同类别资产的风险/收益状况等，判断宏观经济发展趋势、政策导向和证券市场的未来发展趋势，确定和构造合适的资产配置比例。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金 80%以上基金资产投资于其他经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额(含 QDII、香港互认基金)。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	15,677,311.50	2.29	57,206,564.97	6.85
交易性金融资产-基金投资	631,409,381.19	92.36	728,199,842.85	87.13
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	647,086,692.69	94.65	785,406,407.82	93.98

6.4.9.4.3.2 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	32,255,172.23	35,018,573.70
	2.组合自身基准下降 5%	-32,255,172.23	-35,018,573.70

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	646,191,615.29
第二层次	34,367,827.70
第三层次	895,077.40
合计	681,454,520.39

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;对于定期开放的基金投资,本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次;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,其账面价值与公允价值相差很小。

§ 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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	15,677,311.50	2.28

	其中：股票	15,677,311.50	2.28
2	基金投资	631,409,381.19	91.98
3	固定收益投资	34,367,827.70	5.01
	其中：债券	34,367,827.70	5.01
	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	3,881,360.75	0.57
8	其他资产	1,159,937.08	0.17
9	合计	686,495,818.22	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,028,600.00	0.44
C	制造业	9,995,634.10	1.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	895,077.40	0.13
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,758,000.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	15,677,311.50	2.29

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600176	中国巨石	148,590	2,586,951.90	0.38
2	002812	恩捷股份	10,000	2,504,500.00	0.37
3	002648	卫星化学	79,055	2,043,571.75	0.30
4	688063	派能科技	6,400	1,998,080.00	0.29
5	600057	厦门象屿	200,000	1,758,000.00	0.26
6	601088	中国神华	50,000	1,665,000.00	0.24
7	000975	银泰黄金	140,000	1,363,600.00	0.20
8	600956	新天绿能	73,367	895,077.40	0.13
9	603195	公牛集团	5,400	825,714.00	0.12
10	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01

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	300498	温氏股份	2,751,510.60	0.33
2	002812	恩捷股份	2,553,998.00	0.31
3	601899	紫金矿业	2,471,609.00	0.30
4	603517	绝味食品	2,027,172.00	0.24
5	300450	先导智能	2,014,499.00	0.24
6	688063	派能科技	1,866,477.64	0.22
7	601668	中国建筑	1,629,490.00	0.19
8	000975	银泰黄金	1,435,613.00	0.17
9	603363	傲农生物	1,359,927.70	0.16
10	002460	赣锋锂业	1,215,536.00	0.15
11	002245	蔚蓝锂芯	1,184,019.00	0.14
12	000933	神火股份	1,108,258.00	0.13
13	000997	新大陆	1,100,560.00	0.13
14	601666	平煤股份	1,087,316.00	0.13
15	300274	阳光电源	1,040,086.00	0.12
16	300896	爱美客	1,009,428.00	0.12
17	600956	新天绿能	999,992.21	0.12
18	300014	亿纬锂能	951,369.00	0.11
19	600111	北方稀土	946,155.00	0.11
20	300073	当升科技	940,943.00	0.11

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	600887	伊利股份	3,503,358.00	0.42
2	600406	国电南瑞	3,465,497.60	0.41
3	300498	温氏股份	2,821,090.00	0.34
4	601166	兴业银行	2,819,682.00	0.34
5	600970	中材国际	2,671,794.00	0.32
6	600060	海信视像	2,370,661.77	0.28
7	603517	绝味食品	2,254,431.00	0.27
8	600685	中船防务	2,196,965.00	0.26
9	002368	太极股份	2,124,476.60	0.25
10	600882	妙可蓝多	2,074,164.00	0.25
11	601899	紫金矿业	1,925,713.00	0.23
12	600519	贵州茅台	1,816,761.00	0.22
13	603179	新泉股份	1,785,450.08	0.21
14	600703	三安光电	1,740,503.00	0.21
15	601668	中国建筑	1,647,000.00	0.20
16	601728	中国电信	1,642,167.76	0.20
17	601088	中国神华	1,630,688.00	0.20
18	603008	喜临门	1,619,786.00	0.19
19	601877	正泰电器	1,617,099.00	0.19
20	600741	华域汽车	1,608,900.00	0.19

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	32,942,743.48
卖出股票收入（成交）总额	68,907,728.98

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	34,367,827.70	5.03
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	34,367,827.70	5.03

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	200,000	20,224,465.75	2.96
2	019641	20 国债 11	76,810	7,867,570.44	1.15
3	019658	21 国债 10	55,600	5,665,914.19	0.83
4	019664	21 国债 16	6,000	609,877.32	0.09

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

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金在开放式基金投资方面,基于南方基金基金评价系统对全市场基金公司及其管理的基金的评级,将力求投资于管理规范、业绩优良的基金管理公司的基金,以分享资本市场的成长。

在股票型基金选择上,对于主动管理的股票型基金,使用动量策略,重点参考基金规模、历史年化收益率、是否开放申购赎回等因素,选择优胜者进行投资。对于指数基金,由于具有高透明度、风格明确、费用低等多项优势,通过优选指数基金,可配合市场、行业板块轮动等,在不同指数基金间调换,同时可运用事件套利、配对交易等组合策略套利等,增强基金投资收益。被动管理的指数基金,使用跟踪误差、累计偏离、基金规模、是否是市场基准指数、是否开放申购赎回等因素,选择优胜者进行投资。

在混合型基金选择上,考虑到混合型基金投资仓位的变化、基金投资风格、投资标的等因素,将重点选择业绩优异、风格鲜明、风险控制较好的基金进行投资。

对于主动管理的债券基金、货币市场基金,采用长期投资业绩领先、基金规模较大、流动性较好、持有债券的平均久期适当、可以准确识别信用风险并且投资操作风格与当前市场环境相匹配的基金管理人,重点参考基金规模、历史年化收益率、波动率、夏普比例、是否开放申购赎回等因素。

大宗商品基金选择上,重点选择具备有效抵御通胀,与其他资产的相关度低的基金。

在上市的ETF、LOF的套利投资方面,通过量化套利策略以及先进的交易手段,及时捕捉市场的折溢价机会。

南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)以基金为主要投资标的构建投资组合。因此,组合面临因子基金暂停大额赎回而产生的流动性风险。此外基金可参与股票、债券和商品等多资产投资,因此组合可能面临各大类资产的市场风险、利率风险、流动性风险等。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比 例(%)	是否属于 基金管理 人及管理 人关联方 所管理的 基金
1	007130	中庚小盘 价值股票	契约型开 放式	20,915,52 5.24	46,986,72 7.45	6.87	否
2	007217	浙商智能 行业优选 混合C	契约型开 放式	25,876,05 0.53	41,652,67 8.54	6.09	否
3	005794	银华心怡	契约型开	12,617,67	41,065,47	6.01	否

		灵活配置混合 A	放式	2.92	8.29		
4	014967	建信潜力新蓝筹股票 C	契约型开放式	8,550,398.34	33,859,577.43	4.95	否
5	750001	安信策略精选灵活配置混合	契约型开放式	11,895,818.31	31,155,148.15	4.56	否
6	003299	嘉实物流产业股票 C	契约型开放式	11,979,880.02	31,027,889.25	4.54	否
7	011066	大成高新技术产业股票 C	契约型开放式	8,615,307.67	30,515,419.77	4.46	否
8	002808	泓德优势领航灵活配置混合	契约型开放式	14,975,336.62	30,437,371.68	4.45	否
9	012940	中泰星元价值优选灵活配置混合 C	契约型开放式	11,839,690.87	29,330,466.19	4.29	否
10	013531	浙商聚潮产业成长混合 C	契约型开放式	11,553,274.14	24,111,683.13	3.53	否
11	000893	工银瑞信创新动力股票	契约型开放式	22,886,014.36	21,947,687.77	3.21	否
12	010291	华泰柏瑞研究精选混合 C	契约型开放式	10,893,477.36	18,281,433.71	2.67	否
13	006551	中庚价值领航混合	契约型开放式	6,955,267.17	17,109,957.24	2.50	否
14	009439	西部利得中证国有企业红利指数增强(LOF)C	契约型开放式	8,392,931.32	17,007,436.03	2.49	否
15	008657	景顺长城科技创新混合 A	契约型开放式	11,036,199.54	15,917,510.60	2.33	否
16	007216	浙商港股通中华交易服务预期高股息	契约型开放式	12,305,893.50	15,195,317.29	2.22	否

		指数增强 C					
17	006348	银华盛利混合 A	契约型开放式	4,446,183.04	14,422,528.55	2.11	否
18	006528	富国优质发展混合 C	契约型开放式	6,639,388.49	13,928,773.11	2.04	否
19	001667	南方转型增长灵活配置混合 A	契约型开放式	6,596,565.65	13,925,350.09	2.04	是
20	015384	万家瑞隆混合 C	契约型开放式	5,887,966.66	13,616,511.70	1.99	否
21	012449	广发睿毅领先混合 C	契约型开放式	4,774,576.98	13,500,116.41	1.97	否
22	519975	长信量化中小盘股票	契约型开放式	7,749,531.23	12,616,236.84	1.85	否
23	260112	景顺长城能源基建混合	契约型开放式	6,422,795.46	11,522,495.06	1.69	否
24	014499	南方转型增长灵活配置混合 C	契约型开放式	5,358,713.32	11,280,091.54	1.65	是
25	007450	兴全多维价值混合 C	契约型开放式	5,932,752.33	11,020,087.45	1.61	否
26	007386	浙商中证 500 指数增强 C	契约型开放式	5,252,679.99	8,590,758.12	1.26	否
27	000294	华安生态优先混合 A	契约型开放式	2,121,097.30	8,548,022.12	1.25	否
28	000326	南方中小盘成长股票	契约型开放式	4,032,840.35	6,592,887.40	0.96	是
29	006594	博道中证 500 指数增强 C	契约型开放式	3,271,314.32	6,491,269.01	0.95	否
30	012778	中欧养老产业混合 C	契约型开放式	2,110,705.85	5,905,754.97	0.86	否

31	004868	交银施罗德股息优化混合	契约型开放式	1,825,651.89	5,151,076.81	0.75	否
32	518880	华安易富黄金 ETF	契约型开放式	1,280,000.00	4,887,040.00	0.71	否
33	012238	工银瑞信养老产业股票 C	契约型开放式	2,288,992.34	4,209,456.91	0.62	否
34	014977	华安生态优先混合 C	契约型开放式	1,043,710.32	4,203,021.46	0.61	否
35	515700	平安中证新能源汽车产业 ETF	契约型开放式	1,200,000.00	3,648,000.00	0.53	否
36	000363	国泰聚信价值优势灵活配置混合 C	契约型开放式	1,201,941.93	3,131,058.73	0.46	否
37	159949	华安创业板 50ETF	契约型开放式	2,040,000.00	2,533,680.00	0.37	否
38	515790	华泰柏瑞中证光伏产业 ETF	契约型开放式	1,200,000.00	2,030,400.00	0.30	否
39	159857	天弘中证光伏产业 ETF	契约型开放式	1,142,700.00	1,619,205.90	0.24	否
40	515030	华夏中证新能源汽车 ETF	契约型开放式	600,000.00	1,414,200.00	0.21	否
41	010696	工银瑞信金融地产行业混合 C	契约型开放式	385,208.01	996,147.91	0.15	否
42	511990	华宝现金添益交易货币 A	契约型开放式	85.00	8,499.92	0.00	否
43	511660	建信现金添益交易货币 H	契约型开放式	73.00	7,299.49	0.00	否
44	003474	南方天天利货币 B	契约型开放式	5,429.24	5,429.24	0.00	是
45	511810	南方理财金交易货	契约型开放式	22.00	2,199.93	0.00	是

		币 H					
--	--	-----	--	--	--	--	--

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	53,802.40
2	应收清算款	1,000,000.00
3	应收股利	0.33
4	应收利息	-
5	应收申购款	100,502.09
6	其他应收款	5,632.26
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,159,937.08

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600956	新天绿能	895,077.40	0.13	非公开发行锁定期

§ 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
南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)A	5,369	140,608.43	288,546.48	0.04%	754,638,120.09	99.96%
南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)C	945	18,826.33	1,000,382.22	5.62%	16,790,498.40	94.38%
合计	6,314	122,381.62	1,288,928.70	0.17%	771,428,618.49	99.83%

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	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)A	412,525.45	0.0546%
	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)C	856,180.37	4.8125%
	合计	1,268,705.82	0.1642%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)A	0
	南方浩睿进取京选3个月持	0

	有混合(FOF)C	
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)A	0
	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)C	50~100
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)A	南方浩睿进取京选3个月持有混合(FOF)C
基金合同生效日(2021年4月20日)基金份额总额	1,095,694,101.24	23,162,690.31
本报告期期初基金份额总额	815,464,318.93	19,075,850.03
本报告期基金总申购份额	4,455,814.46	967,767.42
减：报告期基金总赎回份额	64,993,466.82	2,252,736.83
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	754,926,666.57	17,790,880.62

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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）。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金财产、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。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内,南方浩睿进取京选 FOF 所投资的南方中证申万有色金属 ETF 针对增加转融通证券出借业务,删除中小板、权证并相应调整投资策略、投资限制、估值方法、费用收支、信息披露等相关内容的议案进行表决,经研究决定,南方浩睿进取京选 FOF 投赞成票。

10.6 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。

10.7 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
华泰证券	3	62,161,066.81	61.71%	56,796.06	61.67%	-
华西证券	1	38,570,191.31	38.29%	35,298.05	38.33%	-

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

10.8.2 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
华泰证券	32,712,183.20	100.00%	-	-	-	-	100,933,796.35	74.36%
华西证券	1,435.26	0.00%	-	-	-	-	34,795,937.70	25.64%

10.9 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关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金获配新天绿能（600956）非公开发行A股的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-11
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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-18
4	南方基金关于旗下部分基金增加诺亚正行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-23
5	南方基金关于旗下部分基金增加宁波银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会	2022-04-18

		会基金电子披露网站	
6	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-24
7	南方基金关于旗下部分基金增加广发证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-02

§ 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浩睿进取京选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)的文件;
- 2、《南方浩睿进取京选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》;
- 3、《南方浩睿进取京选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)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、《南方浩睿进取京选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)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>