

南方价值臻选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：中国工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。

基金托管人中国工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.....	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.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	13
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.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51

7.12 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.....	53
§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.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
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	南方价值臻选混合型证券投资基金	
基金简称	南方价值臻选混合	
基金主代码	012426	
交易代码	012426	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 21 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	477,161,426.98 份	
基金合同存续期		
下属分级基金的基金简称	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C
下属分级基金的交易代码	012426	012427
报告期末下属分级基金的份 额总额	454,733,602.36 份	22,427,824.62 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，紧密跟踪中国经济转型的发展方向，精选质地优秀、具备长期价值增长潜力的公司。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	沪深 300 指数收益率×40%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
		郭明
		010-66105799
		custody@icbc.com.cn

客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	010-66105798
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518017	100140
法定代表人	周易	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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、南方价值臻选混合 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	-31,609,215.31
本期利润	-44,395,543.33
加权平均基金份额本期利润	-0.0935
本期加权平均净值利润率	-9.89%
本期基金份额净值增长率	-8.18%
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	-12,412,560.94
期末可供分配基金份额利润	-0.0273
期末基金资产净值	442,321,041.42
期末基金份额净值	0.9727
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	-2.73%
-------------	--------

2、南方价值臻选混合 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	-1,664,057.71
本期利润	-2,497,953.68
加权平均基金份额本期利润	-0.1033
本期加权平均净值利润率	-10.96%
本期基金份额净值增长率	-8.47%
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	-746,267.20
期末可供分配基金份额利润	-0.0333
期末基金资产净值	21,681,557.42
期末基金份额净值	0.9667
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	-3.33%

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

南方价值臻选混合 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	6.74%	0.81%	4.19%	0.54%	2.55%	0.27%
过去三个月	5.00%	0.88%	3.71%	0.69%	1.29%	0.19%
过去六个月	-8.18%	0.96%	-2.98%	0.74%	-5.20%	0.22%
过去一年	-2.72%	0.85%	-5.77%	0.63%	3.05%	0.22%
自基金合同生效起至今	-2.73%	0.84%	-4.64%	0.62%	1.91%	0.22%

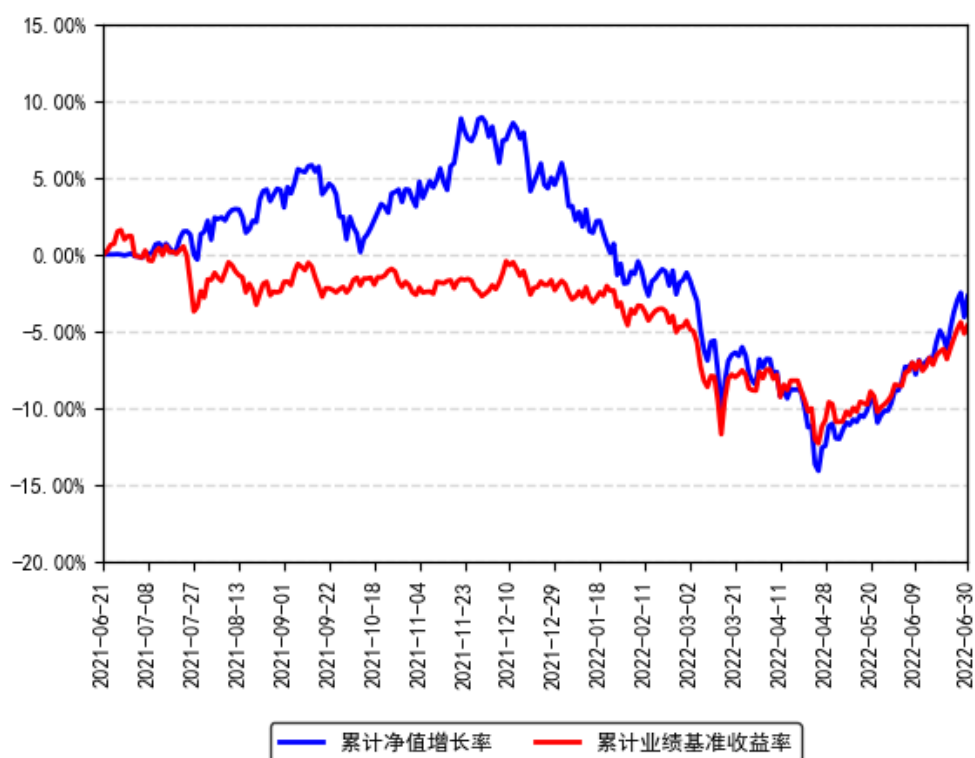
南方价值臻选混合 C

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

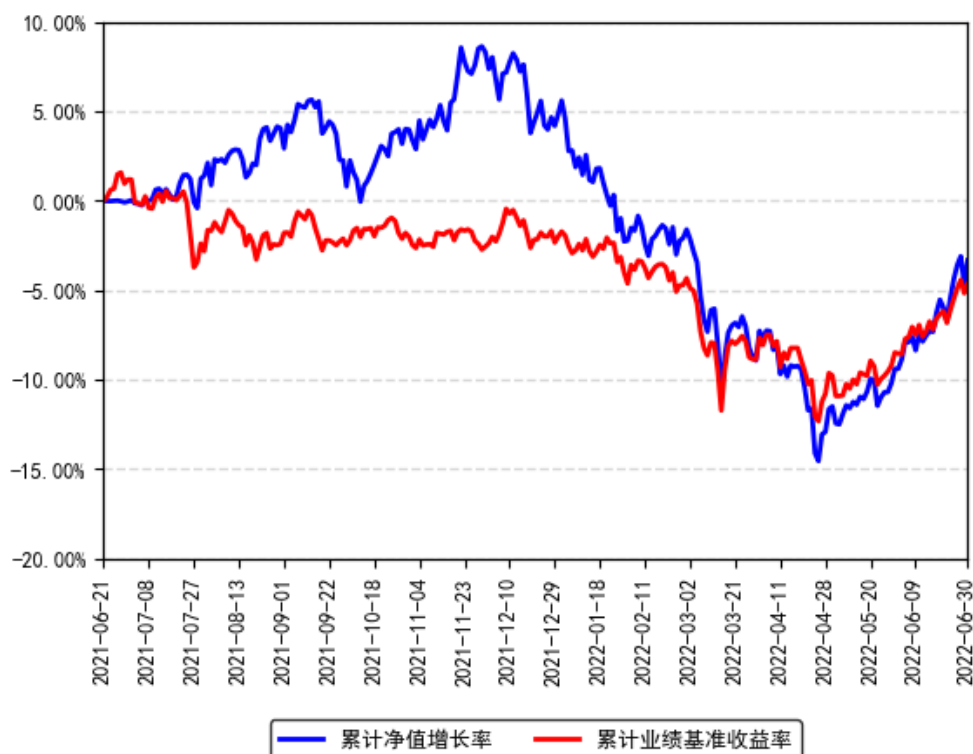
		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	6.69%	0.81%	4.19%	0.54%	2.50%	0.27%
过去三个月	4.84%	0.87%	3.71%	0.69%	1.13%	0.18%
过去六个月	-8.47%	0.96%	-2.98%	0.74%	-5.49%	0.22%
过去一年	-3.30%	0.85%	-5.77%	0.63%	2.47%	0.22%
自基金合同 生效起至今	-3.33%	0.84%	-4.64%	0.62%	1.31%	0.22%

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

南方价值臻选混合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



南方价值臻选混合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		
卢玉珊	本基金基金经理	2021 年 6 月 21 日	-	13 年	女，清华大学会计学硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金，历任研究部研究员、高级研究员，负责纺织服装、商贸零售的行业研究工作；2015 年 2 月 26 日至 2015 年 12 月 30 日，任南方成份、南方安心的基金经理助理；2015 年 5 月 19 日至 2015 年 12 月 30 日，任南方改革机遇的基金经理助理；2015 年 12 月 30 日至 2019 年 1 月 9 日，任南方安心基金经理；2019 年 1 月 9 日至今，任南方核心竞争混合基金经理；2019 年 1 月 25 日至今，任南方改革机遇基金经理；2020 年 5 月 15 日至今，任南方君选基金经理；2021 年 6 月 21 日至今，任南方价值臻选混合基金经理；2022 年 2 月 7 日至今，任南方比较优势混合基金经理。

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。

4.2 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

回顾上半年，市场经历了快速下跌之后又迎来了大幅反弹，尤其是新能源相关的行业反弹较大。截止到6月30日，上证指数下跌6.63%，沪深300下跌9.22%，宁组合和茅指数10.83%，中证1000下跌12.67%，深成指下跌13.20%，创业板下跌15.41%。分行业看，煤炭行业上涨31.38%，是唯一取得正收益的行业，地产、有色、银行、建筑下跌2%左右，电子、计算机、传媒、军工有20%以上的下跌。我们在下跌过程中进行了仓位控制和结构调整，但是在反弹初期，仍然对市场处于谨慎态度，在犹豫中错过了景气成长标的最佳配置窗口，导致在反弹初期跑输，后续通过发掘结构性机会缩小了一部分差距。

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0.9727元，报告期内，份额净值增长率为-8.18%，同期业绩基准增长率为-2.98%；本基金C份额净值为0.9667元，报告期内，份额净值增长率为-8.47%，同期业绩基准增长率为-2.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们将以更积极的心态来应对市场的结构性机会。国内接力政策逐渐明确，市场风险偏好以小幅提升为主，新能源或许仍是市场的主赛道，光伏、电动车、汽车零部件和智能化、风电、储能都值得长期重点关注。对于市场规模持续扩大，行业渗透率低的行业，我们可以从中发掘出很多机会。稳定高ROE赛道中，消费医药估值压降的压力缓解，在宏观不确定性的背景下，也有绝对收益的机会。随着新股的大量发行，次新股存在较大的研究不足，蕴含着较大的预期差。

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

本报告期内，本基金托管人在对南方价值臻选混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，南方价值臻选混合型证券投资基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方价值臻选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回

价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方价值臻选混合型证券投资基金 2022 年度中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方价值臻选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	12,287,698.91	79,456,524.80
结算备付金		9,989,778.25	1,093,138.49
存出保证金		121,630.91	292,629.98
交易性金融资产	6.4.3.2	363,843,522.24	482,212,163.12
其中：股票投资		337,172,803.77	423,495,449.72
基金投资		-	-
债券投资		26,670,718.47	58,716,713.40
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	80,000,000.00	50,400,000.00
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		2,564,602.18	-
应收股利		188,210.18	-
应收申购款		119,172.92	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.3.5	-	1,353,677.18
资产总计		469,114,615.59	614,808,133.57
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		3,345,412.49	52,828,937.10
应付赎回款		765,981.02	-
应付管理人报酬		553,287.65	768,143.47
应付托管费		92,214.62	128,023.92
应付销售服务费		10,381.03	14,859.97
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.48	0.58
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	344,739.46	1,015,532.09
负债合计		5,112,016.75	54,755,497.13
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	477,161,426.98	528,725,500.19
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	-13,158,828.14	31,327,136.25
净资产合计		464,002,598.84	560,052,636.44
负债和净资产总计		469,114,615.59	614,808,133.57

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，南方价值臻选混合 A 份额净值 0.9727 元，基金份额总额 454,733,602.36 份；南方价值臻选混合 C 份额净值 0.9667 元，基金份额总额 22,427,824.62 份；总份额合计 477,161,426.98 份。

6.2 利润表

会计主体：南方价值臻选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 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-42,625,496.65	541,341.19
1.利息收入		729,351.15	278,506.40
其中：存款利息收入	6.4.3.9	217,864.55	125,016.07

债券利息收入		-	14,785.57
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		511,486.60	138,704.76
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-29,800,452.52	114,625.50
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-32,594,057.96	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	338,613.06	-
资产支持证券投资	6.4.3.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.13	-	-
股利收益	6.4.3.14	2,454,992.38	114,625.50
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）	6.4.3.15	-13,620,223.99	148,014.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	65,828.71	195.29
减：二、营业总支出		4,268,000.36	717,891.65
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	3,519,311.68	537,866.32
2.托管费	6.4.6.2.2	586,551.99	89,644.37
3.销售服务费	6.4.6.2.3	68,091.19	6,595.33
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		0.76	17.35
8.其他费用	6.4.3.17	94,044.74	83,768.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-46,893,497.01	-176,550.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-46,893,497.01	-176,550.46

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-46,893,497.01	-176,550.46

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方价值臻选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）	528,725,500.19	-	31,327,136.25	560,052,636.44
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）	528,725,500.19	-	31,327,136.25	560,052,636.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-51,564,073.21	-	-44,485,964.39	-96,050,037.60
（一）、综合收益总额	-	-	-46,893,497.01	-46,893,497.01
（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）	-51,564,073.21	-	2,407,532.62	-49,156,540.59
其中：1.基金申购款	8,681,213.28	-	-484,025.03	8,197,188.25
2.基金赎回款	-60,245,286.49	-	2,891,557.65	-57,353,728.84
（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)	477,161,426.98	-	-13,158,828.14	464,002,598.84
项目	上年度可比期间 2021 年 6 月 21 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)	1,454,269,719.47	-	-	1,454,269,719.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-176,550.46	-176,550.46
(一)、综合收益总额	-	-	-176,550.46	-176,550.46
(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)	-	-	-	-
其中: 1.基金申购款	-	-	-	-
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)	1,454,269,719.47	-	-176,550.46	1,454,093,169.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 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 79,456,524.80 元、人民币 1,093,138.49 元、人民币 292,629.98 元、人民币 50,400,000.00 元、人民币 1,353,677.18 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 79,464,379.62 元、人民币 1,093,630.39 元、人民币 292,761.68 元、人民币 50,400,000.00 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 482,212,163.12 元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 1,345,198.76 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 483,557,361.88 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	12,287,698.91
等于：本金	12,286,129.80
加：应计利息	1,569.11
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	12,287,698.91

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	339,238,584.25	-	337,172,803.77	-2,065,780.48	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	26,171,952.50	489,385.69	26,670,718.47	9,380.28
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	26,171,952.50	489,385.69	26,670,718.47	9,380.28
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	365,410,536.75	489,385.69	363,843,522.24	-2,056,400.20	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	80,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	80,000,000.00	-

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	303.61
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	260,133.29
其中：交易所市场	260,133.29
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
其他	-
合计	344,739.46

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方价值臻选混合 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	502,057,092.04	502,057,092.04
本期申购	7,265,259.35	7,265,259.35
本期赎回（以“-”号填列）	-54,588,749.03	-54,588,749.03
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	454,733,602.36	454,733,602.36

南方价值臻选混合 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	26,668,408.15	26,668,408.15
本期申购	1,415,953.93	1,415,953.93
本期赎回（以“-”号填列）	-5,656,537.46	-5,656,537.46
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	22,427,824.62	22,427,824.62

注：1. 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

南方价值臻选混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	35,748,763.42	-5,916,457.21	29,832,306.21
本期利润	-31,609,215.31	-12,786,328.02	-44,395,543.33
本期基金份额交易产生的变动数	-2,032,059.58	4,182,735.76	2,150,676.18
其中：基金申购款	241,592.08	-679,503.52	-437,911.44
基金赎回款	-2,273,651.66	4,862,239.28	2,588,587.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,107,488.53	-14,520,049.47	-12,412,560.94

南方价值臻选混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,807,524.31	-312,694.27	1,494,830.04
本期利润	-1,664,057.71	-833,895.97	-2,497,953.68
本期基金份额交易产生的变动数	-172,363.83	429,220.27	256,856.44
其中：基金申购款	60,001.35	-106,114.94	-46,113.59
基金赎回款	-232,365.18	535,335.21	302,970.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-28,897.23	-717,369.97	-746,267.20

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	193,224.90
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	22,690.52
其他	1,949.13
合计	217,864.55

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	432,352,345.80
减：卖出股票成本总额	463,642,116.46
减：交易费用	1,304,287.30
买卖股票差价收入	-32,594,057.96

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 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	268,177.83
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	70,435.23
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	338,613.06

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	60,916,560.98
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	59,422,653.60
减：应计利息总额	1,423,445.56
减：交易费用	26.59
买卖债券差价收入	70,435.23

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 资产支持证券投资收益

6.4.3.12.1 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。

6.4.3.13 衍生工具收益

6.4.3.13.1 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。

6.4.3.13.2 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。

6.4.3.14 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	2,454,992.38
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	2,454,992.38
----	--------------

6.4.3.15 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	-13,620,223.99
——股票投资	-13,664,744.47
——债券投资	44,520.48
——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	-13,620,223.99

6.4.3.16 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	65,766.34
基金转换费收入	62.37
合计	65,828.71

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。

6.4.3.17 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	474.00
其他	268.18
合计	94,044.74

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
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 6 月 21 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	211,380.07	0.03%	-	-

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	103.57	0.01%	103.57	0.04%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 6 月 21 日(基金合同生效日) 至 2021 年 6 月 30 日			

	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	-	-	-	-

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 6 月 21 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	3,519,311.68	537,866.32
其中：支付销售机构的客户维护费	1,462,776.42	-

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}$ 。

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 6 月 21 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	586,551.99	89,644.37

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$ 。

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		
	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C	合计
工商银行	-	24,241.54	24,241.54
华泰证券	-	1,278.76	1,278.76

南方基金	-	12,222.57	12,222.57
兴业证券	-	87.66	87.66
合计	-	37,830.53	37,830.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 6 月 21 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		
	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C	合计
工商银行	-	2,007.79	2,007.79
华泰证券	-	105.53	105.53
南方基金	-	1,039.69	1,039.69
兴业证券	-	5.58	5.58
合计	-	3,158.59	3,158.59

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 0.60% 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 类基金份额的基金资产净值 × 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 6 月 21 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
工商银行	12,287,698.91	193,224.90	92,212,910.64	124,921.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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	688048	长光华芯	网下申购	3,247	262,357.60
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	3,387	192,652.56
华泰联合	123145	药石转债	配债	489	48,900.00
兴业证券	600030	中信证券	配股	17,460	251,947.80

上年度可比期间 2021 年 6 月 21 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	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-

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
301109	军信股份	2022	6 个月	新股锁	34.81	16.14	748	26,037.88	12,072.72	-

		年 4 月 6 日		定期							
301109	军信股份	2022 年 6 月 17 日	1-6 个月(含)	锁定期转增	-	16.14	374	-	6,036.36	-	
301150	中一科技	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定期	163.56	82.76	149	24,370.44	12,331.24	-	
301150	中一科技	2022 年 6 月 10 日	1-6 个月(含)	锁定期转增	-	82.76	74	-	6,124.24	-	
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	203	13,008.24	7,616.56	-	
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股锁定期	56.88	56.42	339	19,282.32	19,126.38	-	
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期	17.27	14.83	1,605	27,718.35	23,802.15	-	
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定期	173.98	87.82	100	17,398.00	8,782.00	-	
301219	腾远钴业	2022 年 5 月 24 日	1-6 个月(含)	锁定期转增	-	87.82	80	-	7,025.60	-	
301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股锁定期	19.18	32.07	1,413	27,101.34	45,314.91	-	
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	-	
688261	东微半导	2022 年 1 月 26 日	6 个月	新股锁定期	130.00	230.70	1,904	247,520.00	439,252.80	-	
688281	华秦科技	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新股锁定期	189.50	246.22	1,424	269,848.00	350,617.28	-	

688281	华秦科技	2022 年 6 月 6 日	1-6 个 月 (含)	锁定期 转增	-	246.2 2	570	-	140,345.40	-
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
113060	浙 22 转债	2022 年 6 月 15 日	1 个月 内 (含)	配债未 上市	100.0 0	100.0 1	1,150	115,008.57	115,008.57	-

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和债券投资等。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,将风险控制可在可承受的范围内。

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工商银行,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,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。

于 2022 年 6 月 30 日,本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.1 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、存出保证金、债券投资和买入返售金融资产等。

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	12,287,698.91	-	-	-	12,287,698.91
结算备付金	9,989,778.25	-	-	-	9,989,778.25
存出保证金	121,630.91	-	-	-	121,630.91
交易性金融资产	26,455,539.27	-	215,179.20	337,172,803.77	363,843,522.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	80,000,000.00	-	-	-	80,000,000.00
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,564,602.18	2,564,602.18
应收股利	-	-	-	188,210.18	188,210.18
应收申购款	95.00	-	-	119,077.92	119,172.92
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	128,854,742.34	-	215,179.20	340,044,694.05	469,114,615.59
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	-	-	-	3,345,412.49	3,345,412.49
应付赎回款	-	-	-	765,981.02	765,981.02

应付管理人报酬	-	-	-	553,287.65	553,287.65
应付托管费	-	-	-	92,214.62	92,214.62
应付销售服务费	-	-	-	10,381.03	10,381.03
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.48	0.48
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	344,739.46	344,739.46
负债总计	-	-	-	5,112,016.75	5,112,016.75
利率敏感度缺口	128,854,742.34	-	215,179.20	334,932,677.30	464,002,598.84
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	79,456,524.80	-	-	-	79,456,524.80
结算备付金	1,093,138.49	-	-	-	1,093,138.49
存出保证金	292,629.98	-	-	-	292,629.98
交易性金融资产	58,578,713.40	-	138,000.00	423,495,449.72	482,212,163.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	50,400,000.00	-	-	-	50,400,000.00
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	1,353,677.18	1,353,677.18
资产总计	189,821,006.67	-	138,000.00	424,849,126.90	614,808,133.57
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	-	-	-	52,828,937.10	52,828,937.10
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	768,143.47	768,143.47
应付托管费	-	-	-	128,023.92	128,023.92
应付销售服务费	-	-	-	14,859.97	14,859.97
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.58	0.58
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,015,532.09	1,015,532.09
负债总计	-	-	-	54,755,497.13	54,755,497.13
利率敏感度缺口	189,821,006.67	-	138,000.00	370,093,629.77	560,052,636.44

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	-7,049.75	-10,457.67
2.市场利率平行下降25个基点	7,114.25	10,513.49	

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					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	28,318,973.76	-	-	-	28,318,973.76
资产合计	-	28,318,973.76	-	-	-	28,318,973.76
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	-	28,318,973.76	-	-	-	28,318,973.76

项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	2,664,885.44	-	-	-	2,664,885.44
资产合计	-	2,664,885.44	-	-	-	2,664,885.44
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	-	2,664,885.44	-	-	-	2,664,885.44

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	上年度末（2021 年 12

	30 日)	月 31 日)
1. 所有外币相对人民币升值 5%	1,415,948.69	133,244.27
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-1,415,948.69	-133,244.27

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，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(含存托凭证)投资占基金资产的比例范围为 30%-80%(其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%)。本基金每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和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	337,172,803.77	72.67	423,495,449.72	75.62
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	337,172,803.77	72.67	423,495,449.72	75.62

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%	17,522,944.60	17,483,161.00
2. 沪深 300 下降 5%	-17,522,944.60	-17,483,161.00	

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	334,846,637.67
第二层次	26,570,547.84
第三层次	2,426,336.73
合计	363,843,522.24

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	337,172,803.77	71.87
	其中：股票	337,172,803.77	71.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	26,670,718.47	5.69
	其中：债券	26,670,718.47	5.69
	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	80,000,000.00	17.05
	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	22,277,477.16	4.75
8	其他资产	2,993,616.19	0.64
9	合计	469,114,615.59	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 27,840,614.68 元，占基金资产净值比例 6.00%；通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 478,359.08 元，占基金资产净值比例 0.10%。

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	1,004,625.00	0.22
B	采矿业	8,173,001.64	1.76
C	制造业	221,852,604.55	47.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,042,900.00	1.73
E	建筑业	4,309,968.50	0.93
F	批发和零售业	3,723,513.75	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	11,178,049.00	2.41
H	住宿和餐饮业	962,240.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,606,144.42	0.78
J	金融业	22,306,909.80	4.81
K	房地产业	6,505,454.00	1.40

L	租赁和商务服务业	4,944,708.30	1.07
M	科学研究和技术服务业	6,073,504.17	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	4,252,827.88	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,468,144.00	0.32
R	文化、体育和娱乐业	449,235.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	308,853,830.01	66.56

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	1,792,392.72	0.39
材料	2,874,896.50	0.62
工业	-	-
非必需消费	6,512,502.75	1.40
必需消费品	5,106,168.46	1.10
医疗保健	5,626,949.23	1.21
金融	3,022,214.10	0.65
科技	240,633.36	0.05
通讯	2,258,317.34	0.49
公用事业	-	-
房地产	884,899.30	0.19
政府	-	-
合计	28,318,973.76	6.10

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	7,700	15,746,500.00	3.39
2	300750	宁德时代	11,400	6,087,600.00	1.31
3	002831	裕同科技	168,600	4,982,130.00	1.07
4	000001	平安银行	284,000	4,254,320.00	0.92
5	000002	万科 A	192,200	3,940,100.00	0.85
6	600030	中信证券	177,460	3,843,783.60	0.83
7	603259	药明康德	35,400	3,681,246.00	0.79
8	09992	泡泡玛特	113,400	3,675,486.89	0.79
9	600487	亨通光电	248,700	3,616,098.00	0.78
10	01579	颐海国际	148,000	3,581,877.80	0.77
11	300122	智飞生物	31,200	3,463,512.00	0.75

12	000858	五 粮 液	17,100	3,453,003.00	0.74
13	603323	苏农银行	665,400	3,393,540.00	0.73
14	603833	欧派家居	21,600	3,254,688.00	0.70
15	603345	安井食品	18,700	3,139,169.00	0.68
16	600298	安琪酵母	63,800	3,110,250.00	0.67
17	688598	金博股份	10,292	3,033,052.40	0.65
18	002531	天顺风能	182,800	3,014,372.00	0.65
19	600346	恒力石化	129,800	2,886,752.00	0.62
20	603067	振华股份	217,772	2,728,683.16	0.59
21	601877	正泰电器	76,000	2,719,280.00	0.59
22	600057	厦门象屿	306,300	2,692,377.00	0.58
23	002142	宁波银行	68,410	2,449,762.10	0.53
24	002129	TCL 中环	40,500	2,385,045.00	0.51
25	002318	久立特材	148,400	2,372,916.00	0.51
26	603583	捷昌驱动	70,840	2,365,347.60	0.51
27	600176	中国巨石	129,343	2,251,861.63	0.49
28	603681	永冠新材	90,100	2,214,658.00	0.48
29	300014	亿纬锂能	22,600	2,203,500.00	0.47
30	000100	TCL 科技	446,500	2,138,735.00	0.46
31	002158	汉钟精机	89,600	2,083,200.00	0.45
32	600741	华域汽车	90,100	2,072,300.00	0.45
33	603179	新泉股份	69,810	2,024,490.00	0.44
34	002493	荣盛石化	131,450	2,023,015.50	0.44
35	002709	天赐材料	32,000	1,985,920.00	0.43
36	601668	中国建筑	368,000	1,957,760.00	0.42
37	000776	广发证券	104,343	1,951,214.10	0.42
38	600323	瀚蓝环境	95,000	1,947,500.00	0.42
39	300760	迈瑞医疗	6,200	1,941,840.00	0.42
40	600004	白云机场	129,500	1,930,845.00	0.42
41	603693	江苏新能	98,700	1,895,040.00	0.41
42	603690	至纯科技	45,700	1,841,710.00	0.40
43	000155	川能动力	83,000	1,838,450.00	0.40
44	600765	中航重机	57,100	1,837,478.00	0.40
45	603129	春风动力	16,000	1,819,520.00	0.39
46	600009	上海机场	31,700	1,797,390.00	0.39
47	688377	迪 威 尔	57,899	1,791,974.05	0.39
48	603806	福 斯 特	27,020	1,770,350.40	0.38
49	002352	顺丰控股	31,400	1,752,434.00	0.38
50	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.29
51	00883	中国海洋石油	45,000	398,689.58	0.09
52	000876	新 希 望	109,200	1,670,760.00	0.36
53	603871	嘉友国际	98,840	1,670,396.00	0.36

54	000519	中兵红箭	57,300	1,670,295.00	0.36
55	600566	济川药业	61,000	1,656,760.00	0.36
56	600886	国投电力	157,100	1,649,550.00	0.36
57	03908	中金公司	114,400	1,635,780.07	0.35
58	002245	蔚蓝锂芯	69,400	1,610,774.00	0.35
59	000983	山西焦煤	117,700	1,576,003.00	0.34
60	688617	惠泰医疗	6,942	1,520,853.36	0.33
61	600315	上海家化	35,500	1,517,625.00	0.33
62	603866	桃李面包	91,540	1,514,987.00	0.33
63	600522	中天科技	64,600	1,492,260.00	0.32
64	000708	中信特钢	73,800	1,487,070.00	0.32
65	300408	三环集团	49,314	1,484,351.40	0.32
66	300999	金龙鱼	27,400	1,480,148.00	0.32
67	300782	卓胜微	10,942	1,477,170.00	0.32
68	600048	保利发展	84,500	1,475,370.00	0.32
69	300755	华致酒行	33,400	1,464,590.00	0.32
70	02500	启明医疗-B	97,500	1,459,167.94	0.31
71	601899	紫金矿业	155,200	1,448,016.00	0.31
72	600521	华海药业	63,200	1,434,640.00	0.31
73	603899	晨光股份	25,500	1,430,040.00	0.31
74	603588	高能环境	123,960	1,429,258.80	0.31
75	002484	江海股份	61,200	1,428,408.00	0.31
76	603236	移远通信	10,564	1,411,984.24	0.30
77	03800	协鑫科技	430,000	1,393,703.14	0.30
78	03323	中国建材	194,000	1,390,299.49	0.30
79	002027	分众传媒	206,400	1,389,072.00	0.30
80	00388	香港交易所	4,200	1,386,434.03	0.30
81	002271	东方雨虹	26,700	1,374,249.00	0.30
82	600893	航发动力	30,100	1,369,851.00	0.30
83	600585	海螺水泥	38,500	1,358,280.00	0.29
84	300474	景嘉微	19,800	1,354,122.00	0.29
85	601628	中国人寿	43,100	1,339,548.00	0.29
86	600309	万华化学	13,800	1,338,462.00	0.29
87	300772	运达股份	52,480	1,335,091.20	0.29
88	301071	力量钻石	8,600	1,334,118.00	0.29
89	688778	厦钨新能	11,958	1,332,958.26	0.29
90	603816	顾家家居	23,270	1,317,780.10	0.28
91	600195	中牧股份	102,200	1,252,972.00	0.27
92	300587	天铁股份	61,000	1,246,230.00	0.27
93	300628	亿联网络	15,800	1,203,170.00	0.26
94	600887	伊利股份	30,700	1,195,765.00	0.26
95	688052	纳芯微	3,153	1,194,860.88	0.26
96	688408	中信博	12,835	1,186,980.80	0.26

97	002948	青岛银行	326,900	1,183,378.00	0.26
98	002176	江特电机	45,900	1,149,336.00	0.25
99	300986	志特新材	30,660	1,128,288.00	0.24
100	688063	派能科技	3,600	1,123,920.00	0.24
101	688262	国芯科技	22,756	1,107,762.08	0.24
102	300337	银邦股份	100,100	1,104,103.00	0.24
103	600063	皖维高新	145,200	1,100,616.00	0.24
104	600383	金地集团	81,100	1,089,984.00	0.23
105	300569	天能重工	92,835	1,067,602.50	0.23
106	01801	信达生物	35,500	1,059,537.65	0.23
107	601128	常熟银行	138,400	1,057,376.00	0.23
108	300601	康泰生物	23,040	1,040,947.20	0.22
109	600456	宝钛股份	17,500	1,039,500.00	0.22
110	688021	奥福环保	31,250	1,035,937.50	0.22
111	06969	思摩尔国际	50,000	1,034,779.90	0.22
112	688162	巨一科技	18,104	1,032,109.04	0.22
113	600029	南方航空	140,900	1,029,979.00	0.22
114	300680	隆盛科技	39,400	1,021,248.00	0.22
115	09922	九毛九	57,000	1,016,350.56	0.22
116	688665	四方光电	6,861	1,015,428.00	0.22
117	06078	海吉亚医疗	22,600	1,007,918.38	0.22
118	600882	妙可蓝多	21,500	1,006,200.00	0.22
119	000089	深圳机场	130,100	1,004,372.00	0.22
120	002508	老板电器	27,500	990,825.00	0.21
121	600389	江山股份	16,300	989,899.00	0.21
122	00564	郑煤机	125,600	988,189.15	0.21
123	688696	极米科技	3,203	986,107.61	0.21
124	688050	爱博医疗	4,392	984,686.40	0.21
125	300724	捷佳伟创	10,900	973,915.00	0.21
126	002436	兴森科技	86,000	969,220.00	0.21
127	600258	首旅酒店	38,800	962,240.00	0.21
128	000516	国际医学	88,600	957,766.00	0.21
129	600872	中炬高新	27,400	948,314.00	0.20
130	600732	爱旭股份	28,700	947,674.00	0.20
131	002756	永兴材料	6,200	943,702.00	0.20
132	01024	快手-W	12,600	941,769.44	0.20
133	002046	国机精工	68,500	937,080.00	0.20
134	000672	上峰水泥	59,120	932,913.60	0.20
135	002049	紫光国微	4,900	929,628.00	0.20
136	600761	安徽合力	77,800	925,820.00	0.20
137	601456	国联证券	75,400	925,158.00	0.20
138	002091	江苏国泰	85,377	917,802.75	0.20
139	603324	盛剑环境	22,400	915,712.00	0.20

140	688120	华海清科	3,681	914,360.40	0.20
141	300725	药石科技	9,200	910,708.00	0.20
142	688363	华熙生物	6,390	908,530.20	0.20
143	600153	建发股份	68,300	892,681.00	0.19
144	002928	华夏航空	75,500	888,635.00	0.19
145	01209	华润万象生活	26,600	884,899.30	0.19
146	002192	融捷股份	5,696	875,475.20	0.19
147	002815	崇达技术	68,000	871,080.00	0.19
148	600497	驰宏锌锗	167,000	866,730.00	0.19
149	001228	永泰运	15,942	863,259.30	0.19
150	002304	洋河股份	4,700	860,805.00	0.19
151	601827	三峰环境	120,500	857,960.00	0.18
152	603185	上机数控	5,460	851,705.40	0.18
153	003043	华亚智能	14,300	851,422.00	0.18
154	688186	广大特材	26,505	845,509.50	0.18
155	300825	阿尔特	55,300	844,431.00	0.18
156	002028	思源电气	23,600	841,576.00	0.18
157	603086	先达股份	86,563	839,661.10	0.18
158	603609	禾丰股份	87,000	837,810.00	0.18
159	601233	桐昆股份	52,700	836,876.00	0.18
160	01928	金沙中国有限公司	52,000	832,476.15	0.18
161	00700	腾讯控股	2,700	818,314.21	0.18
162	000543	皖能电力	203,300	811,167.00	0.17
163	09926	康方生物-B	41,000	808,197.31	0.17
164	600330	天通股份	65,800	783,678.00	0.17
165	603987	康德莱	39,000	777,270.00	0.17
166	01378	中国宏桥	100,500	762,346.30	0.16
167	600803	新奥股份	41,000	762,190.00	0.16
168	600600	青岛啤酒	7,300	758,616.00	0.16
169	601857	中国石油	142,100	753,130.00	0.16
170	002415	海康威视	20,500	742,100.00	0.16
171	603456	九洲药业	14,200	734,140.00	0.16
172	688075	安旭生物	4,177	731,016.77	0.16
173	601878	浙商证券	64,000	728,320.00	0.16
174	002842	翔鹭钨业	84,600	722,484.00	0.16
175	01898	中煤能源	127,000	722,250.71	0.16
176	603055	台华新材	57,200	718,432.00	0.15
177	600399	抚顺特钢	39,700	710,630.00	0.15
178	601225	陕西煤业	33,300	705,294.00	0.15
179	002466	天齐锂业	5,600	698,880.00	0.15
180	601166	兴业银行	34,600	688,540.00	0.15

181	601006	大秦铁路	103,400	681,406.00	0.15
182	300193	佳士科技	72,600	680,988.00	0.15
183	603589	口子窖	11,600	679,876.00	0.15
184	000400	许继电气	35,100	673,920.00	0.15
185	000301	东方盛虹	39,300	664,563.00	0.14
186	300896	爱美客	1,100	660,011.00	0.14
187	00853	微创医疗	33,900	659,543.91	0.14
188	601058	赛轮轮胎	58,200	655,914.00	0.14
189	301191	菲菱科思	8,100	652,779.00	0.14
190	601611	中国核建	77,200	647,708.00	0.14
191	601800	中国交建	69,700	646,816.00	0.14
192	300791	仙乐健康	20,600	643,132.00	0.14
193	603369	今世缘	12,600	642,600.00	0.14
194	301050	雷电微力	6,300	639,828.00	0.14
195	01548	金斯瑞生物科技	26,000	632,584.04	0.14
196	300957	贝泰妮	2,900	630,837.00	0.14
197	605358	立昂微	9,176	618,278.88	0.13
198	601088	中国神华	18,500	616,050.00	0.13
199	601985	中国核电	89,800	616,028.00	0.13
200	688003	天准科技	17,529	578,457.00	0.12
201	603218	日月股份	22,400	568,960.00	0.12
202	688356	键凯科技	2,323	561,724.63	0.12
203	002353	杰瑞股份	13,900	560,170.00	0.12
204	600366	宁波韵升	44,300	558,180.00	0.12
205	601390	中国中铁	90,500	555,670.00	0.12
206	300498	温氏股份	25,900	551,411.00	0.12
207	688202	美迪西	1,577	535,564.97	0.12
208	688599	天合光能	8,126	530,221.50	0.11
209	601238	广汽集团	34,700	528,828.00	0.11
210	688023	安恒信息	3,581	528,770.46	0.11
211	301238	瑞泰新材	14,121	523,516.95	0.11
212	688685	迈信林	18,275	522,665.00	0.11
213	605111	新洁能	4,100	515,821.00	0.11
214	601311	骆驼股份	46,300	515,319.00	0.11
215	300015	爱尔眼科	11,400	510,378.00	0.11
216	688131	皓元医药	3,580	508,682.20	0.11
217	688025	杰普特	10,191	505,269.78	0.11
218	688208	道通科技	15,310	504,005.20	0.11
219	300347	泰格医药	4,400	503,580.00	0.11
220	000065	北方国际	59,410	502,014.50	0.11
221	03690	美团-W	3,000	498,233.69	0.11
222	600690	海尔智家	18,000	494,280.00	0.11

223	002013	中航机电	39,900	492,765.00	0.11
224	002839	张家港行	93,000	491,970.00	0.11
225	688281	华秦科技	1,994	490,962.68	0.11
226	00241	阿里健康	106,000	489,510.76	0.11
227	301150	中一科技	5,323	486,584.48	0.10
228	000725	京东方 A	123,100	485,014.00	0.10
229	603733	仙鹤股份	18,000	478,800.00	0.10
230	002132	恒星科技	65,700	476,982.00	0.10
231	603279	景津装备	15,300	474,453.00	0.10
232	600021	上海电力	45,900	470,475.00	0.10
233	300595	欧普康视	8,200	468,958.00	0.10
234	603985	恒润股份	16,640	468,249.60	0.10
235	002171	楚江新材	49,900	465,567.00	0.10
236	605123	派克新材	3,300	464,376.00	0.10
237	002312	川发龙蟒	26,900	464,294.00	0.10
238	603855	华荣股份	18,200	464,100.00	0.10
239	000333	美的集团	7,600	458,964.00	0.10
240	688516	奥特维	1,706	455,416.70	0.10
241	002714	牧原股份	8,200	453,214.00	0.10
242	300035	中科电气	16,200	452,790.00	0.10
243	688388	嘉元科技	5,304	450,150.48	0.10
244	300217	东方电热	73,500	449,820.00	0.10
245	000501	武商集团	40,400	448,440.00	0.10
246	688033	天宜上佳	20,820	442,216.80	0.10
247	300415	伊之密	24,200	441,166.00	0.10
248	002938	鹏鼎控股	14,600	441,066.00	0.10
249	688261	东微半导	1,904	439,252.80	0.09
250	000623	吉林敖东	29,700	438,372.00	0.09
251	002984	森麒麟	13,900	432,429.00	0.09
252	688139	海尔生物	5,924	431,444.92	0.09
253	002812	恩捷股份	1,700	425,765.00	0.09
254	603209	兴通股份	18,600	422,592.00	0.09
255	688677	海泰新光	4,552	418,738.48	0.09
256	002988	豪美新材	26,000	417,820.00	0.09
257	002555	三七互娱	19,100	405,493.00	0.09
258	002765	蓝黛科技	49,400	398,658.00	0.09
259	688233	神工股份	7,067	397,165.40	0.09
260	300731	科创新源	15,800	386,942.00	0.08
261	600984	建设机械	58,370	378,237.60	0.08
262	300482	万孚生物	9,200	374,532.00	0.08
263	002001	新和成	16,200	369,522.00	0.08
264	301061	匠心家居	10,720	363,408.00	0.08
265	601636	旗滨集团	28,400	362,100.00	0.08

266	600582	天地科技	74,500	356,110.00	0.08
267	688223	晶科能源	23,579	352,034.47	0.08
268	603520	司太立	11,620	326,754.40	0.07
269	301129	瑞纳智能	5,500	323,565.00	0.07
270	002487	大金重工	7,700	321,321.00	0.07
271	688630	芯碁微装	4,600	297,620.00	0.06
272	002138	顺络电子	10,700	291,575.00	0.06
273	688676	金盘科技	10,337	268,762.00	0.06
274	603613	国联股份	2,900	256,940.00	0.06
275	300083	创世纪	21,300	244,950.00	0.05
276	02382	舜宇光学科 技	2,200	240,633.36	0.05
277	603096	新经典	12,800	236,160.00	0.05
278	600328	中盐化工	9,900	233,145.00	0.05
279	300633	开立医疗	7,700	231,231.00	0.05
280	605183	确成股份	11,800	227,740.00	0.05
281	688155	先惠技术	2,108	219,653.60	0.05
282	833533	骏创科技	20,667	216,590.16	0.05
283	300251	光线传媒	22,500	213,075.00	0.05
284	688386	泛亚微透	3,535	191,915.15	0.04
285	603606	东方电缆	2,400	183,840.00	0.04
286	688290	景业智能	3,040	154,736.00	0.03
287	688536	思瑞浦	200	112,318.00	0.02
288	605369	拱东医疗	800	99,360.00	0.02
289	300151	昌红科技	3,200	60,480.00	0.01
290	601012	隆基绿能	840	55,969.20	0.01
291	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
292	002311	海大集团	600	36,006.00	0.01
293	600660	福耀玻璃	800	33,448.00	0.01
294	688601	力芯微	188	28,200.00	0.01
295	301217	铜冠铜箔	1,605	23,802.15	0.01
296	301207	华兰疫苗	339	19,126.38	0.00
297	301109	军信股份	1,122	18,109.08	0.00
298	301219	腾远钴业	180	15,807.60	0.00
299	301180	万祥科技	654	13,701.30	0.00
300	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
301	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
302	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
303	301196	唯科科技	203	7,616.56	0.00
304	600459	贵研铂业	80	1,448.80	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	603693	江苏新能	4,264,101.00	0.76
2	601668	中国建筑	4,257,365.00	0.76
3	300122	智飞生物	3,602,191.00	0.64
4	09992	泡泡玛特	3,593,548.25	0.64
5	000876	新希望	3,193,535.00	0.57
6	002129	TCL 中环	3,093,764.34	0.55
7	01579	颐海国际	3,086,608.48	0.55
8	002831	裕同科技	3,069,465.20	0.55
9	603323	苏农银行	3,065,848.00	0.55
10	300014	亿纬锂能	3,032,825.00	0.54
11	002158	汉钟精机	2,697,292.00	0.48
12	603806	福斯特	2,540,710.44	0.45
13	002555	三七互娱	2,513,023.00	0.45
14	002318	久立特材	2,477,466.00	0.44
15	688139	海尔生物	2,462,860.97	0.44
16	300760	迈瑞医疗	2,451,149.00	0.44
17	600346	恒力石化	2,416,008.00	0.43
18	300207	欣旺达	2,392,276.00	0.43
19	300438	鹏辉能源	2,378,592.00	0.42
20	300373	扬杰科技	2,229,377.00	0.40

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	002648	卫星化学	5,861,814.00	1.05
2	601012	隆基绿能	5,617,345.00	1.00
3	300763	锦浪科技	5,603,735.00	1.00
4	300569	天能重工	5,515,325.45	0.98
5	300750	宁德时代	5,454,561.00	0.97
6	603323	苏农银行	3,823,230.00	0.68
7	300014	亿纬锂能	3,710,538.00	0.66
8	300015	爱尔眼科	3,693,784.00	0.66
9	002567	唐人神	3,625,800.00	0.65
10	002466	天齐锂业	3,509,656.00	0.63
11	300207	欣旺达	3,293,260.00	0.59

12	605358	立昂微	3,280,203.49	0.59
13	002245	蔚蓝锂芯	3,127,630.00	0.56
14	603303	得邦照明	3,083,268.00	0.55
15	603606	东方电缆	3,049,831.00	0.54
16	600563	法拉电子	3,035,630.00	0.54
17	300777	中简科技	3,031,438.00	0.54
18	002049	紫光国微	3,003,232.00	0.54
19	002045	国光电器	3,000,917.00	0.54
20	000776	广发证券	2,915,620.00	0.52

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	390,984,214.98
卖出股票收入（成交）总额	432,352,345.80

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	26,455,539.27	5.70
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）	215,179.20	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,670,718.47	5.75

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	019658	21 国债 10	259,610	26,455,539.27	5.70
2	113060	浙 22 转债	1,150	115,008.57	0.02

3	123145	药石转债	489	68,346.23	0.01
4	113059	福莱转债	250	31,824.40	0.01

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

无。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，泡泡玛特国际集团有限公司在报告编制日前一年内曾受到北京市朝阳区市场监管局的处罚；中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚；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	121,630.91
2	应收清算款	2,564,602.18
3	应收股利	188,210.18
4	应收利息	-
5	应收申购款	119,172.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,993,616.19

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
南方价值臻选混合	5,230	86,947.15	779,431.14	0.17%	453,954,171.22	99.83%

A						
南方价值臻选混合 C	1,044	21,482.59	-	-	22,427,824.62	100.00%
合计	6,274	76,053.78	779,431.14	0.16%	476,381,995.84	99.84%

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	南方价值臻选混合 A	540,407.05	0.1188%
	南方价值臻选混合 C	5,001.00	0.0223%
	合计	545,408.05	0.1143%

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	南方价值臻选混合 A	0
	南方价值臻选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方价值臻选混合 A	0~10
	南方价值臻选混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C
基金合同生效日(2021年6月21日)基金份额总额	1,409,686,126.75	44,583,592.72
本报告期期初基金份额总额	502,057,092.04	26,668,408.15
本报告期基金总申购份额	7,265,259.35	1,415,953.93
减：报告期基金总赎回份额	54,588,749.03	5,656,537.46
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-

本报告期末基金份额总额	454,733,602.36	22,427,824.62
-------------	----------------	---------------

§ 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）。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			额的比例			
申万宏源	2	272,706,832.88	33.41%	249,033.08	33.47%	-
金元证券	1	183,735,700.73	22.51%	166,733.89	22.41%	-
中信建投	1	133,355,531.83	16.34%	121,574.38	16.34%	-
中泰证券	1	65,888,234.50	8.07%	60,455.56	8.13%	-
中金公司	1	54,249,454.94	6.65%	49,371.80	6.64%	-
光大证券	1	50,952,496.76	6.24%	46,370.38	6.23%	-
海通证券	1	23,831,637.73	2.92%	21,766.87	2.93%	-
国联证券	1	20,608,068.87	2.52%	18,770.19	2.52%	-
中信证券	2	10,752,399.37	1.32%	9,798.77	1.32%	-
华泰证券	3	211,380.07	0.03%	103.57	0.01%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	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
申万宏源	-	-	-	-	-	-
金元证券	26,303,305.80	97.75%	4,037,305,000.00	77.96%	-	-
中信建投	-	-	812,100,000.00	15.68%	-	-
中泰证券	50,037.28	0.19%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	305,188.60	1.13%	329,300,000.00	6.36%	-	-
国联证券	250,903.70	0.93%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

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关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-28
3	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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-07
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-12
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-26
6	南方基金关于旗下部分基金增加创金启富为销售机构及开通相关业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-31
7	南方基金关于旗下部分基金增加招商银行为销售机构及开通相关业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-07
8	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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-15
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-16
10	南方基金关于旗下部分基金增加招商银行为销售机构及开通相关业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-19
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-22

§ 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价值臻选混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方价值臻选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方价值臻选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、《南方价值臻选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>