

# 南方佳元 6 个月持有期债券型证券投资 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：中信银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
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.....	48
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 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方佳元 6 个月持有期债券型证券投资基金	
基金简称	南方佳元 6 个月持有债券	
基金主代码	012397	
交易代码	012397	
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	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,310,704,613.09 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方佳元 6 个月持有债券 A	南方佳元 6 个月持有债券 C
下属分级基金的交易代码	012397	012398
报告期末下属分级基金的份 额总额	317,001,911.25 份	993,702,701.84 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票，通过严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	本基金将采取自上而下的投资策略对各种投资工具进行合理的配置。在风险与收益的匹配方面，力求降低信用风险，并在良好控制利率风险与市场风险的基础上力争为投资者获取稳定的收益。具体投资策略包括： 1、信用债券投资策略；2、收益率曲线策略；3、放大策略；4、资产支持证券投资策略；5、国债期货投资策略；6、可转换债券及可交换债券投资策略；7、股票投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×8%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×2%+中债新综合财富指数收益率×90%
风险收益特征	本基金为债券型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
		姜敏

	联系电话	0755-82763888	4006800000
	电子邮箱	manager@southernfund.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		400-889-8899	95558
传真		0755-82763889	010-85230024
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层	
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层	
邮政编码	518017	100020	
法定代表人	周易	朱鹤新	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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、南方佳元 6 个月持有债券 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	2,379,448.25
本期利润	2,322,857.83
加权平均基金份额本期利润	0.0086
本期加权平均净值利润率	0.84%
本期基金份额净值增长率	0.31%
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	7,787,565.02
期末可供分配基金份额利润	0.0245

期末基金资产净值	327,267,468.46
期末基金份额净值	1.0324
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	3.24%

## 2、南方佳元 6 个月持有债券 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	6,996,194.39
本期利润	-1,658,275.97
加权平均基金份额本期利润	-0.0015
本期加权平均净值利润率	-0.15%
本期基金份额净值增长率	0.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	20,803,811.74
期末可供分配基金份额利润	0.0209
期末基金资产净值	1,022,228,039.38
期末基金份额净值	1.0287
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	2.87%

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

## 南方佳元 6 个月持有债券 A

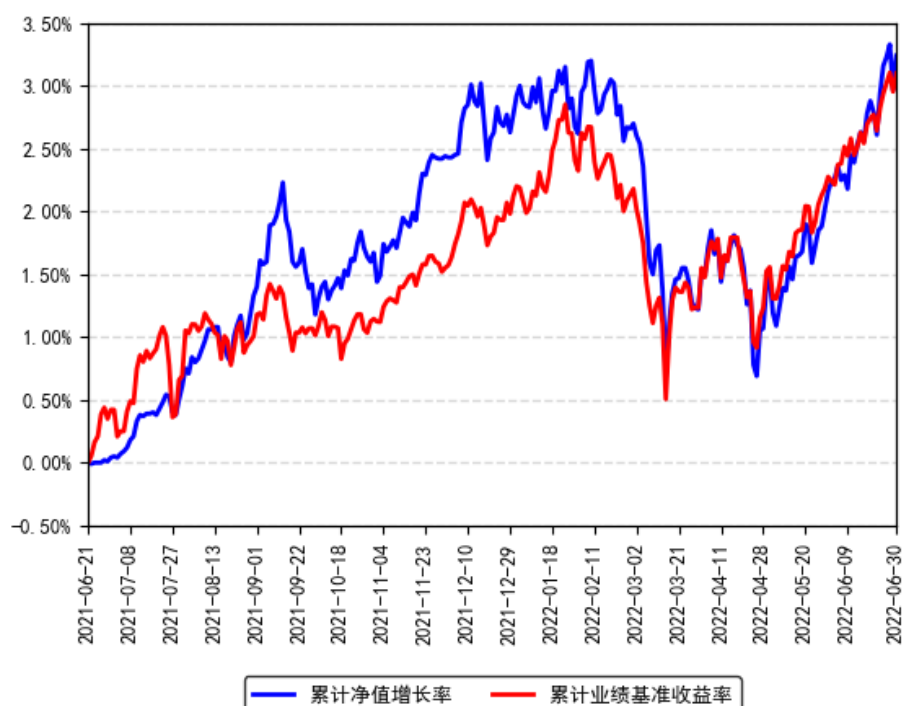
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.06%	0.16%	0.80%	0.10%	0.26%	0.06%
过去三个月	1.72%	0.18%	1.60%	0.14%	0.12%	0.04%
过去六个月	0.31%	0.19%	0.88%	0.16%	-0.57%	0.03%
过去一年	3.20%	0.15%	2.67%	0.13%	0.53%	0.02%
自基金合同生效起至今	3.24%	0.15%	3.10%	0.13%	0.14%	0.02%

## 南方佳元 6 个月持有债券 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	1.02%	0.16%	0.80%	0.10%	0.22%	0.06%
过去三个月	1.63%	0.18%	1.60%	0.14%	0.03%	0.04%
过去六个月	0.14%	0.19%	0.88%	0.16%	-0.74%	0.03%
过去一年	2.84%	0.15%	2.67%	0.13%	0.17%	0.02%
自基金合同 生效起至今	2.87%	0.15%	3.10%	0.13%	-0.23%	0.02%

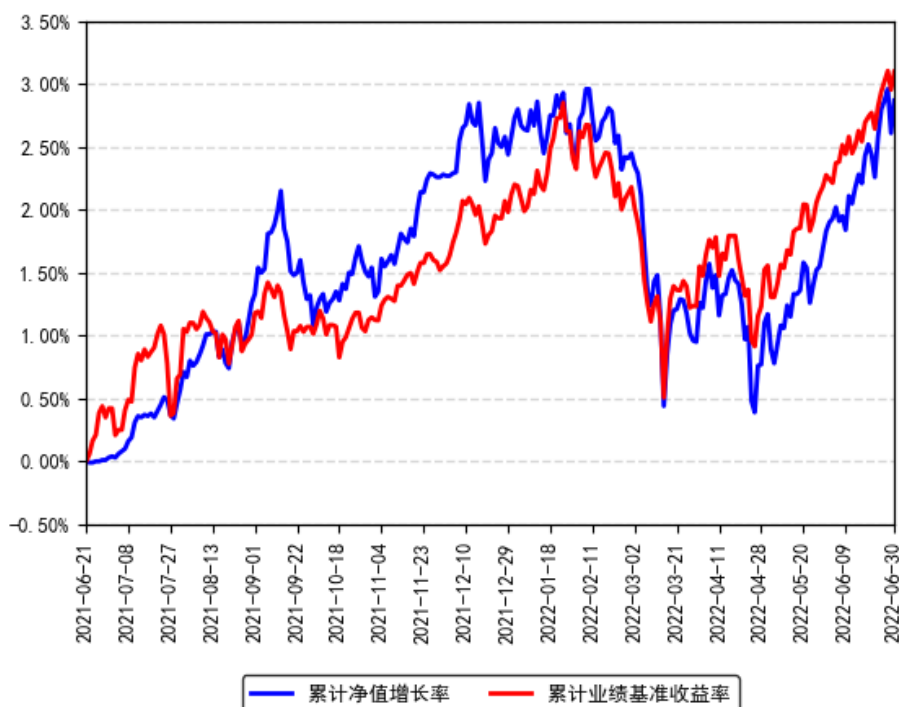
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方佳元6个月持有债券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





南方佳元6个月持有债券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		
孙鲁闽	本基金基金经理	2021年6月21日	-	19年	南开大学理学和经济学双学士、澳大利亚新南威尔士大学商学硕士，具有基金从业资格。曾任职于厦门国际银行福州分行，2003年4月加入南方基金，历任行业研究员、南方高增和南方隆元的基金经理助理、专户投资管理部总监助理、权益投资部副总监，现任联席首席投资官、董事总经理；2007年12月17日至2010年12月14日，任投资经理。2011年6月21日至2017年7月15日，任南方保本基金基金经理；2015年12月23日至2017年12月30日，任南方瑞利保本基金基金经理；2015年5月29日至2018年6月5日，任南方丰合保本基金基金经理；2016年1月11日至2019年1月18日，任南方益和保本基金基金经理；2010年12月14日至2019年5月30日，任南方避险基金经理；2018年6月15日至2019年7月5日，任南方甄智混合基金经理；2017年12月30日至2019年9月23日，任南方瑞利混合基金经理；2018年6月5日至2019年9月23日，任南方新蓝筹混合基金经理；2018年6月8日至2019年9月23日，任南方改革机遇基金经理；2019年1月18日至2019年9月23日，任南方益和混合基金经理；2018年11月5日至2020年4月1日，任南方固胜定期开放混合基金经理；2015年4月17日至2020年5月15日，任南方利淘基金经理；2015年5月20日至2020年5月15日，任南方利鑫基金经理；2017年7月13日至2020年5月15日，任南方安睿混合基金经理；2018年1月29日至2020年5月15日，任南方融尚再融资基金经理；2019年7月5日至2020

				年 5 月 15 日,任南方甄智混合基金经理; 2016 年 11 月 15 日至 2021 年 2 月 26 日,任南方安裕混合基金经理; 2016 年 9 月 22 日至今,任南方安泰混合基金经理; 2019 年 5 月 30 日至今,任南方致远混合基金经理; 2020 年 3 月 5 日至今,任南方宝丰混合基金经理; 2020 年 9 月 11 日至今,兼任投资经理; 2021 年 1 月 6 日至今,任南方宁悦一年持有期混合基金经理; 2021 年 6 月 8 日至今,任南方宝恒混合基金经理; 2021 年 6 月 21 日至今,任南方佳元 6 个月持有债券基金经理; 2022 年 2 月 25 日至今,任南方宝裕混合基金经理。
杨旭	本基金基金经理	2022 年 4 月 1 日	- 13 年	伦敦政治经济学院硕士,具有基金从业资格。曾就职于中国银行股份有限公司总行、华夏基金管理有限公司,历任中国银行总行金融市场总部投资经理、司库投资经理,华夏基金机构债券投资部养老金、年金、专户投资经理。2019 年 12 月加入南方基金,2020 年 2 月 19 日至 2020 年 9 月 25 日,任投资经理; 2020 年 9 月 25 日至今,任南方安泰混合基金经理; 2022 年 4 月 1 日至今,任南方佳元 6 个月持有债券基金经理。

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

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
孙鲁闽	公募基金	7	24,591,470,949.65	2010 年 12 月 14 日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	17	74,432,346,327.08	2007 年 12 月 27 日
	合计	24	99,023,817,276.73	-

#### 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

上半年经济基本面先后遭遇疫情反复、外部俄乌冲突、美联储紧缩的负面冲击，上市公司盈利增长前景深受打击。后续随着稳增长政策的持续加码、疫情防控形势的大幅好转，全国范围内企业复工复产节奏加快，经济动能环比有所恢复。制造业 PMI 在经历了 4 月份低点后于 6 月份重回荣枯线以上，旅游、餐饮等消费也显示出明显的复苏迹象。流动性方面，考虑到国内疫情冲击、经济增长压力、财政收支缺口以及地产去杠杆风险等因素，监管层坚持以我为主并兼顾外部影响，顶着美联储货币政策持续收缩的压力，保持流动性合理充裕，国内十年国债收益率在上半年维持低位震荡。

上半年 A 股整体上呈现出“V”型反转走势，上证指数下跌 6.63%，深圳成指下跌 13.20%，结构上大盘价值风格整体表现较好。从申万行业指数上来看，煤炭板块表现较好，报告期内涨幅超过 30%。TMT 相关的电子、计算机、传媒等板块表现较差，报告期内分别下跌 24.46%、23.64%和 22.25%。

固收方面,上半年债券市场总体呈现震荡走势。由于经济金融数据没有单边上涨或下跌,而是逐月震荡,导致债券收益率调整幅度较小。因央行在二季度维持了明显低于政策利率的短期限利率水平,虽然降准降息未至,但债券期限结构陡峭,留给中短期限品种一定下行空间,资金较为宽松成为收益率较年中高点有所下行的主要推动力。上半年整体来看,3 年 AAA 评级信用债收益率下行 0bp, 3、5、10 年期国债收益率分别下行 1bp、上行 4bp 和 5bp。

报告期末本基金权益仓位维持在 15%的中枢水平,在方向配置上我们坚持一贯投资思路,大体保持不变,主要集中在银行、汽车、食品饮料、电气设备、化工等业绩增长稳定或低估值相关的行业。固收方面,本基金上半年买入 3 年期信用债和 3-10 年期利率债;转债部分以买入低溢价率的银行、公用事业转债为主,同时为保证组合较高的信用资质水平,减持部分信用资质有边际走弱倾向的债券。

#### 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 1.0324 元,报告期内,份额净值增长率为 0.31%,同期业绩基准增长率为 0.88%;本基金 C 份额净值为 1.0287 元,报告期内,份额净值增长率为 0.14%,同期业绩基准增长率为 0.88%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

稳增长措施在加快推进,新增社融占 GDP 比重回升。随着经济下行压力加大及风险的暴露,政策也在加快朝着宽松方向转变,例如纠偏此前严格管控的地产政策,陆续出台稳增长财政及保持宽松的货币政策。在此背景下,我们密切关注未来各项可能超预期的稳增长政策,例如房地产、基建产业链预计存在一定的投资机会。疫情的干扰终将消退,预期拐点出现也将带来消费、航空、旅游等部分板块的修复机会。与此同时,我们也比较关注海外风险,尤其是俄乌冲突以及美联储货币政策的收缩对市场的冲击,近期美联储大幅加息对人民币汇率、A 股表现也造成较大影响。

从 FED 模型上看,市场经历了 5 月、6 月份反弹后,A 股估值处于相对合理的区间;同时监管层采取多种措施呵护,目前看来政策底已经出现。此外,由于债券收益率易下难上、银行理财收益率降低、房地产投资回报下降等问题的长期存在,市场大量长线资金仍倾向配置股市。站在当前时点,我们对 A 股长期表现保持信心。短期内,由于国内疫情和经济增长问题、外部地缘政治和流动性收缩环境,部分风险仍未完全释放,市场情绪干扰较大,预计后续市场将处于震荡阶段,以结构性行情为主。

在操作层面上,我们对业绩兑现存在不确定性的行业和高估值行业和个股继续保持谨慎,坚持自下而上精选业绩确定性高、估值合理及受益于景气持续提升的个股,主要在以下三个方向:第一,高股息类固收品种,例如金融行业;第二,业绩稳定增长板块,例如食品饮料、医药、轻工、家电等业绩稳定增长行业的龙头企业;第三,优质制造业,主要包括化工、汽车、机

械、电力设备与新能源等行业中具备全球竞争力的公司。固收方面，用好存量财政政策和货币短期继续维持宽松构成债券市场的主要基本面因素，预计收益率波动区间进一步缩小，以票息行情为主。组合将维持中性的久期水平（1.5-2.0）和较高的杠杆率水平（120%左右），同时注意利用长久期利率债获取波段收益。

#### 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对南方佳元 6 个月持有期债券型证券投资基金

2022 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在南方佳元 6 个月持有期债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2022 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

# § 6 中期财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：南方佳元 6 个月持有期债券型证券投资基金

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	41,008,258.12	6,038,956.30
结算备付金		-	5,633,367.92
存出保证金		40,706.96	50,630.79
交易性金融资产	6.4.3.2	1,454,597,991.97	1,221,467,141.45
其中：股票投资		224,025,346.86	188,242,856.95
基金投资		-	-
债券投资		1,230,572,645.11	1,033,224,284.50
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	2,600,002.60	-
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		-	1,225,423.69
应收股利		214,999.24	-
应收申购款		336,486.73	1,371,687.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	10,613,782.86
资产总计		1,498,798,445.62	1,246,400,990.52
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		143,702,538.89	187,000,000.00
应付清算款		558.00	2.58
应付赎回款		4,412,055.12	4,670,284.22
应付管理人报酬		621,158.64	499,266.50
应付托管费		112,937.90	90,775.76
应付销售服务费		300,815.59	242,600.92
应付投资顾问费		-	-
应交税费		61,448.58	49,896.97
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	91,425.06	243,885.31
负债合计		149,302,937.78	192,796,712.26
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	1,310,704,613.09	1,025,239,153.49
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	38,790,894.75	28,365,124.77
净资产合计		1,349,495,507.84	1,053,604,278.26
负债和净资产总计		1,498,798,445.62	1,246,400,990.52

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，南方佳元 6 个月持有债券 A 份额净值 1.0324 元，基金份额总额 317,001,911.25 份；南方佳元 6 个月持有债券 C 份额净值 1.0287 元，基金份额总额 993,702,701.84 份；总份额合计 1,310,704,613.09 份。



## 6.2 利润表

会计主体：南方佳元6个月持有期债券型证券投资基金

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		8,285,478.73	202,128.04
1.利息收入		131,061.83	197,394.60
其中：存款利息收入	6.4.3.9	100,640.60	6,076.37
债券利息收入		-	30,464.73
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		30,421.23	160,853.50
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		16,865,477.68	15,326.00
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-3,302,330.42	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	16,696,035.88	-
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.12	-	-
股利收益	6.4.3.13	3,471,772.22	15,326.00
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.3.14	-8,711,060.78	-10,592.56
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.3.15	-	-
减：二、营业总支出		7,620,896.87	67,682.30
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	3,814,992.82	44,086.12
2.托管费	6.4.6.2.2	693,635.01	8,015.66
3.销售服务费	6.4.6.2.3	1,951,060.77	6,847.66

4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		1,006,085.62	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,006,085.62	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		37,694.84	69.79
8.其他费用	6.4.3.16	117,427.81	8,663.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		664,581.86	134,445.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		664,581.86	134,445.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		664,581.86	134,445.74

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方佳元 6 个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,025,239,153.49	-	28,365,124.77	1,053,604,278.26
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）	1,025,239,153.49	-	28,365,124.77	1,053,604,278.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	285,465,459.60	-	10,425,769.98	295,891,229.58
（一）、综合收益总额	-	-	664,581.86	664,581.86
（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）	285,465,459.60	-	9,761,188.12	295,226,647.72
其中：1.基金申	815,883,054.34	-	20,039,784.53	835,922,838.87

购款				
2.基金赎回款	-530,417,594.74	-	-10,278,596.41	-540,696,191.15
(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)	1,310,704,613.09	-	38,790,894.75	1,349,495,507.84
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)	325,065,605.09	-	-	325,065,605.09
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	134,445.74	134,445.74
(一)、综合收益总额	-	-	134,445.74	134,445.74
(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)	325,065,605.09	-	134,445.74	325,200,050.83

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。

本基金在前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 6,038,956.30 元、人民币 5,633,367.92 元、人民币 50,630.79 元、人民币 0.00 元、人民币 10,613,782.86 元、人民币 187,000,000.00 元和人民币 50,289.36 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 6,039,828.37 元、人民币 5,635,999.66 元、人民币 50,656.12 元、人民币 0.00 元、人民币 0.00 元、人民币 187,050,289.36 元和人民币 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产,金额为人民币 1,221,467,141.45 元,归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 10,610,253.72 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产,金额为人民币 1,232,077,395.17 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	38,506,966.92
等于：本金	38,504,215.06
加：应计利息	2,751.86
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	2,501,291.20
等于：本金	2,500,947.92
加：应计利息	343.28
减：坏账准备	-
合计	41,008,258.12

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 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	227,815,037.31	-	224,025,346.86	-3,789,690.45	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	628,430,079.21	9,299,567.24	639,871,775.34	2,142,128.89
	银行间市场	580,169,126.20	8,357,369.77	590,700,869.77	2,174,373.80
	合计	1,208,599,205.41	17,656,937.01	1,230,572,645.11	4,316,502.69
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,436,414,242.72	17,656,937.01	1,454,597,991.97	526,812.24	

#### 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	2,600,002.60	-
银行间市场	-	-
合计	2,600,002.60	-

##### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,140.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	6,140.00
应付利息	-
预提费用	84,302.56
其他	982.50
合计	91,425.06

#### 6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方佳元 6 个月持有债券 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	221,793,523.73	221,793,523.73
本期申购	174,142,880.47	174,142,880.47
本期赎回（以“-”号填列）	-78,934,492.95	-78,934,492.95
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	317,001,911.25	317,001,911.25

南方佳元 6 个月持有债券 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	803,445,629.76	803,445,629.76
本期申购	641,740,173.87	641,740,173.87
本期赎回 (以“-”号填列)	-451,483,101.79	-451,483,101.79
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	993,702,701.84	993,702,701.84

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

#### 6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

南方佳元 6 个月持有债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,500,273.13	2,966,510.51	6,466,783.64
本期利润	2,379,448.25	-56,590.42	2,322,857.83
本期基金份额交易产生的变动数	1,907,843.64	-431,927.90	1,475,915.74
其中：基金申购款	3,363,208.82	126,442.86	3,489,651.68
基金赎回款	-1,455,365.18	-558,370.76	-2,013,735.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,787,565.02	2,477,992.19	10,265,557.21

南方佳元 6 个月持有债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	11,186,378.86	10,711,962.27	21,898,341.13
本期利润	6,996,194.39	-8,654,470.36	-1,658,275.97
本期基金份额交易产生的变动数	2,621,238.49	5,664,033.89	8,285,272.38
其中：基金申购款	10,282,899.88	6,267,232.97	16,550,132.85
基金赎回款	-7,661,661.39	-603,199.08	-8,264,860.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,803,811.74	7,721,525.80	28,525,337.54

#### 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	57,288.81
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	20,858.43
结算备付金利息收入	22,025.51
其他	467.85
合计	100,640.60

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

#### 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	122,979,560.14
减：卖出股票成本总额	125,930,444.88
减：交易费用	351,445.68
买卖股票差价收入	-3,302,330.42

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	16,421,943.52
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	274,092.36
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	16,696,035.88

##### 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	652,648,703.29
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	640,422,208.14
减：应计利息总额	11,942,434.57
减：交易费用	9,968.22
买卖债券差价收入	274,092.36

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

#### 6.4.3.12 衍生工具收益

##### 6.4.3.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

#### 6.4.3.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

#### 6.4.3.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,471,772.22
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,471,772.22

#### 6.4.3.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-8,711,060.78
——股票投资	-8,957,226.73
——债券投资	246,165.95
——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	-8,711,060.78

#### 6.4.3.15 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	14,173.08
其他	352.17

合计	117,427.81
----	------------

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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	290,404,132.97	100.00%	5,107,527.65	100.00%

###### 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	期末应付佣金余	占期末应付佣金

		的比例	额	总额的比例
华泰证券	189,391.62	100.00%	-	-
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	4,446.09	100.00%	4,446.09	100.00%

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	3,814,992.82	44,086.12
其中：支付销售机构的客户维护费	1,727,956.40	-

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 0.55% 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×0.55%/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	693,635.01	8,015.66

注：支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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×0.10%/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

	南方佳元6个月持有债券 A	南方佳元6个月持有债券 C	合计
华泰证券	-	53,078.10	53,078.10
南方基金	-	1,471.93	1,471.93
中信银行	-	37,976.36	37,976.36
合计	-	92,526.39	92,526.39
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		
	南方佳元6个月持有债券 A	南方佳元6个月持有债券 C	合计
华泰证券	-	23.76	23.76
南方基金	-	108.45	108.45
中信银行	-	4,321.17	4,321.17
合计	-	4,453.38	4,453.38

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 0.35% 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×0.35%/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

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	南方佳元 6 个月持有债券 A	南方佳元 6 个月持有债券 C

基金合同生效日（2021 年 6 月 21 日）持有的基金份额	9,999,000.00	-
报告期初持有的基金份额	9,999,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	19,538,872.61	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	29,537,872.61	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.25%	-

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	
	南方佳元 6 个月持有债券 A	南方佳元 6 个月持有债券 C
基金合同生效日（2021 年 6 月 21 日）持有的基金份额	9,999,000.00	-
报告期初持有的基金份额	9,999,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,999,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.07%	-

注：基金管理人南方基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 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
中信银行-银行存款	38,506,966.92	57,288.81	2,508,960.15	6,048.23
中信银行-券商保证金	2,501,291.20	20,858.43	-	-

注：



1. 本基金由基金托管人中信银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

2. 本基金的券商保证金为存放在基金托管人中信银行的基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

#### 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
兴业证券	600030	中信证券	配股	17,820	257,142.60

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
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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 143,702,538.89 元,截至 2022 年 7 月 7 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### 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

本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。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制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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信银行,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于约定开放日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于开放期内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,除卖出回购金融资产款余额中有 143,702,538.89 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外,本基金所承担的其他金融负债的合同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,因此账面余额约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》且于基金开放期内按照《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，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，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。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 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	41,008,258.1 2	-	-	-	41,008,258.1 2
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	40,706.96	-	-	-	40,706.96
交易性金融 资产	368,510,699. 96	852,025,328. 71	10,036,616.4 4	224,025,346. 86	1,454,597,99 1.97
衍生金融资 产	-	-	-	-	-
买入返售金 融资产	2,600,002.60	-	-	-	2,600,002.60
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	-	-	-	214,999.24	214,999.24
应收申购款	-	-	-	336,486.73	336,486.73
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	412,159,667. 64	852,025,328. 71	10,036,616.4 4	224,576,832. 83	1,498,798,44 5.62
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	143,702,538. 89	-	-	-	143,702,538. 89
应付清算款	-	-	-	558.00	558.00
应付赎回款	-	-	-	4,412,055.12	4,412,055.12
应付管理人 报酬	-	-	-	621,158.64	621,158.64
应付托管费	-	-	-	112,937.90	112,937.90
应付销售服 务费	-	-	-	300,815.59	300,815.59
应付投资顾	-	-	-	-	-

问费					
应交税费	-	-	-	61,448.58	61,448.58
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税 负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	91,425.06	91,425.06
负债总计	143,702,538. 89	-	-	5,600,398.89	149,302,937. 78
利率敏感度 缺口	268,457,128. 75	852,025,328. 71	10,036,616.4 4	218,976,433. 94	1,349,495,50 7.84
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	6,038,956.30	-	-	-	6,038,956.30
结算备付金	5,633,367.92	-	-	-	5,633,367.92
存出保证金	50,630.79	-	-	-	50,630.79
交易性金融 资产	513,380,857. 00	425,675,558. 10	94,167,869.4 0	188,242,856. 95	1,221,467,14 1.45
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	-	-	-	1,225,423.69	1,225,423.69
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,371,687.51	1,371,687.51
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	10,613,782.8 6	10,613,782.8 6
资产总计	525,103,812. 01	425,675,558. 10	94,167,869.4 0	201,453,751. 01	1,246,400,99 0.52
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融 负债	-	-	-	-	-
衍生金融负 债	-	-	-	-	-

卖出回购金融资产款	187,000,000.00	-	-	-	187,000,000.00
应付清算款	-	-	-	2.58	2.58
应付赎回款	-	-	-	4,670,284.22	4,670,284.22
应付管理人报酬	-	-	-	499,266.50	499,266.50
应付托管费	-	-	-	90,775.76	90,775.76
应付销售服务费	-	-	-	242,600.92	242,600.92
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	49,896.97	49,896.97
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	243,885.31	243,885.31
负债总计	187,000,000.00	-	-	5,796,712.26	192,796,712.26
利率敏感度缺口	338,103,812.01	425,675,558.10	94,167,869.40	195,657,038.75	1,053,604,278.26

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	-6,144,106.84	-5,378,445.12
2.市场利率平行下降25个基点	6,209,154.91	5,456,133.74	

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位:人民币元

项目	本期末2022年6月30日					合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	

					币	
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	8,474,176.06	-	-	-	8,474,176.06
资产合计	-	8,474,176.06	-	-	-	8,474,176.06
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	-	8,474,176.06	-	-	-	8,474,176.06

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	-	11,519,290.68	-	-	-	11,519,290.68
资产合计	-	11,519,290.68	-	-	-	11,519,290.68
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	-	11,519,290.68	-	-	-	11,519,290.68

#### 6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	423,708.80	575,964.53
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-423,708.80	-575,964.53	

#### 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：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例为 0-20%（其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%）；本基金投资同业存单不超过基金资产的 20%；本基金投资可转换债券和可交换债券合计不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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	224,025,346.86	16.60	188,242,856.95	17.87
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	224,025,346.86	16.60	188,242,856.95	17.87

#### 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%	10,791,739.02	7,596,025.37
2.沪深 300 下降 5%	-10,791,739.02	-7,596,025.37

## 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	242,551,269.24
第二层次	1,212,046,722.73
第三层次	0.00
合计	1,454,597,991.97

#### 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。

## 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §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	224,025,346.86	14.95
	其中：股票	224,025,346.86	14.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,230,572,645.11	82.10
	其中：债券	1,230,572,645.11	82.10
	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	2,600,002.60	0.17
	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	41,008,258.12	2.74
8	其他资产	592,192.93	0.04
9	合计	1,498,798,445.62	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4,445,204.93元，占基金资产净值比例0.33%；通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币4,028,971.13元，占基金资产净值比例0.30%。

### 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	515,942.00	0.04
B	采矿业	6,072,897.00	0.45
C	制造业	145,005,128.70	10.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,256,176.18	0.54
E	建筑业	2,135,448.00	0.16
F	批发和零售业	4,091,448.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	77,509.08	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,999,371.14	0.30
J	金融业	29,316,427.20	2.17
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	9,084,901.50	0.67
M	科学研究和技术服务业	135,187.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	7,860,735.00	0.58
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	215,551,170.80	15.97

### 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	265,793.05	0.02
材料	1,533,629.33	0.11
工业	270,834.40	0.02
非必需消费	-	-
必需消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
科技	1,250,629.86	0.09
通讯	1,131,416.37	0.08
公用事业	4,021,873.05	0.30
房地产	-	-
政府	-	-
合计	8,474,176.06	0.63

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	000001	平安银行	761,000	11,399,780.00	0.84
2	601166	兴业银行	560,700	11,157,930.00	0.83
3	600887	伊利股份	260,700	10,154,265.00	0.75
4	600660	福耀玻璃	231,500	9,679,015.00	0.72
5	600487	亨通光电	610,000	8,869,400.00	0.66
6	600519	贵州茅台	4,000	8,180,000.00	0.61
7	000333	美的集团	130,200	7,862,778.00	0.58
8	601012	隆基绿能	103,400	6,889,542.00	0.51
9	600323	瀚蓝环境	330,300	6,771,150.00	0.50
10	601877	正泰电器	180,800	6,469,024.00	0.48
11	600741	华域汽车	265,300	6,101,900.00	0.45

12	601899	紫金矿业	650,900	6,072,897.00	0.45
13	002648	卫星化学	230,869	5,967,963.65	0.44
14	600176	中国巨石	340,258	5,923,891.78	0.44
15	600057	厦门象屿	610,800	5,368,932.00	0.40
16	300750	宁德时代	10,000	5,340,000.00	0.40
17	600690	海尔智家	189,700	5,209,162.00	0.39
18	002318	久立特材	300,800	4,809,792.00	0.36
19	002415	海康威视	128,700	4,658,940.00	0.35
20	600309	万华化学	44,900	4,354,851.00	0.32
21	600549	厦门钨业	192,300	4,157,526.00	0.31
22	000906	浙商中拓	450,600	4,091,448.00	0.30
23	600886	国投电力	380,000	3,990,000.00	0.30
24	600030	中信证券	184,120	3,988,039.20	0.30
25	002126	银轮股份	331,400	3,794,530.00	0.28
26	002027	分众传媒	552,150	3,715,969.50	0.28
27	603987	康 德 莱	183,700	3,661,141.00	0.27
28	002345	潮 宏 基	748,300	3,434,697.00	0.25
29	603730	岱美股份	243,630	3,193,989.30	0.24
30	603067	振华股份	251,900	3,156,307.00	0.23
31	603589	口 子 窖	53,000	3,106,330.00	0.23
32	601009	南京银行	265,900	2,770,678.00	0.21
33	600803	新奥股份	148,900	2,768,051.00	0.21
34	002645	华宏科技	120,300	2,624,946.00	0.19
35	00836	华润电力	160,000	2,216,652.48	0.16
36	601668	中国建筑	401,400	2,135,448.00	0.16
37	603185	上机数控	12,096	1,886,855.04	0.14
38	688232	新点软件	49,147	1,848,910.14	0.14
39	01816	中广核电力	1,111,000	1,805,220.57	0.13
40	688580	伟思医疗	25,438	1,656,013.80	0.12
41	600764	中国海防	60,900	1,537,116.00	0.11
42	03323	中国建材	214,000	1,533,629.33	0.11
43	603667	五洲新春	95,999	1,523,504.13	0.11
44	000708	中信特钢	72,200	1,454,830.00	0.11
45	002555	三七互娱	64,400	1,367,212.00	0.10
46	00763	中兴通讯	80,000	1,250,629.86	0.09
47	600577	精达股份	220,800	1,225,440.00	0.09
48	300888	稳健医疗	17,900	1,190,350.00	0.09
49	00941	中国移动	27,000	1,131,416.37	0.08
50	603588	高能环境	94,500	1,089,585.00	0.08
51	300138	晨光生物	60,000	934,200.00	0.07
52	002452	长高电新	141,400	917,686.00	0.07
53	605111	新 洁 能	7,000	880,670.00	0.07
54	002439	启明星辰	39,300	783,249.00	0.06

55	002867	周大生	50,000	776,500.00	0.06
56	000935	四川双马	30,300	733,866.00	0.05
57	002171	楚江新材	75,100	700,683.00	0.05
58	603195	公牛集团	4,000	611,640.00	0.05
59	002206	海利得	93,900	593,448.00	0.04
60	300095	华伍股份	44,400	582,528.00	0.04
61	002299	圣农发展	26,900	515,942.00	0.04
62	601985	中国核电	72,613	498,125.18	0.04
63	01186	中国铁建	64,500	270,834.40	0.02
64	00883	中国海洋石油	30,000	265,793.05	0.02
65	300791	仙乐健康	6,400	199,808.00	0.01
66	603259	药明康德	1,300	135,187.00	0.01
67	603565	中谷物流	4,884	77,509.08	0.01

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	601012	隆基绿能	6,263,519.40	0.59
2	601877	正泰电器	5,566,882.00	0.53
3	600887	伊利股份	5,244,698.00	0.50
4	600660	福耀玻璃	4,674,026.00	0.44
5	000333	美的集团	4,413,673.00	0.42
6	600803	新奥股份	4,398,774.08	0.42
7	603667	五洲新春	4,300,908.20	0.41
8	600741	华域汽车	4,219,609.00	0.40
9	600549	厦门钨业	4,076,343.00	0.39
10	600487	亨通光电	3,610,092.00	0.34
11	600690	海尔智家	3,597,207.00	0.34
12	002415	海康威视	3,371,016.90	0.32
13	600309	万华化学	3,310,427.00	0.31
14	600323	瀚蓝环境	3,309,606.00	0.31
15	603987	康德莱	3,288,013.00	0.31
16	002318	久立特材	3,110,703.00	0.30
17	300750	宁德时代	3,063,135.00	0.29
18	688232	新点软件	3,004,323.53	0.29
19	002939	长城证券	2,754,258.00	0.26
20	600057	厦门象屿	2,612,975.00	0.25

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	601009	南京银行	5,605,317.96	0.53
2	600741	华域汽车	3,486,204.00	0.33
3	601928	凤凰传媒	3,203,772.00	0.30
4	002126	银轮股份	3,155,749.00	0.30
5	603667	五洲新春	3,061,843.88	0.29
6	002867	周大生	2,987,563.00	0.28
7	601168	西部矿业	2,978,845.90	0.28
8	01816	中广核电力	2,652,965.38	0.25
9	601088	中国神华	2,636,430.75	0.25
10	002236	大华股份	2,606,092.19	0.25
11	300443	金雷股份	2,539,545.00	0.24
12	002645	华宏科技	2,531,448.00	0.24
13	688598	金博股份	2,460,471.30	0.23
14	688223	晶科能源	2,188,990.95	0.21
15	600057	厦门象屿	2,169,416.00	0.21
16	601166	兴业银行	2,165,228.00	0.21
17	600259	广晟有色	2,152,094.00	0.20
18	002939	长城证券	2,109,764.80	0.20
19	002531	天顺风能	1,920,350.50	0.18
20	300476	胜宏科技	1,914,465.00	0.18

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	170,670,161.52
卖出股票收入（成交）总额	122,979,560.14

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	6,098,773.15	0.45

2	央行票据	-	-
3	金融债券	368,798,321.20	27.33
	其中：政策性金融债	307,334,522.71	22.77
4	企业债券	409,022,158.61	30.31
5	企业短期融资券	183,017,380.84	13.56
6	中期票据	225,411,001.37	16.70
7	可转债（可交换债）	18,525,922.38	1.37
8	同业存单	19,699,087.56	1.46
9	其他	-	-
10	合计	1,230,572,645.11	91.19

## 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	108615	国开 2105	1,120,000	114,661,795.07	8.50
2	220203	22 国开 03	500,000	50,166,027.40	3.72
3	185349	22 国机 01	300,000	30,287,794.52	2.24
4	185642	22 川投 01	300,000	30,195,221.92	2.24
5	018008	国开 1802	285,190	30,099,327.64	2.23

## 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。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等,利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 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,国家开发银行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;中国农业发展银行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	40,706.96
2	应收清算款	-
3	应收股利	214,999.24
4	应收利息	-
5	应收申购款	336,486.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	592,192.93

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	132009	17中油EB	4,226,947.95	0.31
2	132018	G三峡EB1	2,961,573.89	0.22
3	113045	环旭转债	2,926,463.33	0.22
4	113044	大秦转债	2,776,618.77	0.21
5	113050	南银转债	2,065,999.02	0.15
6	123113	仙乐转债	1,424,862.43	0.11
7	113042	上银转债	1,371,232.50	0.10
8	110077	洪城转债	772,224.49	0.06

### 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
南方佳元6个月持有债券A	3,896	81,365.99	94,979,765.96	29.96%	222,022,145.29	70.04%
南方佳元6个月持有债券C	1,118,754	888.22	1,085,515.14	0.11%	992,617,186.70	99.89%
合计	1,122,650	1,167.51	96,065,281.10	7.33%	1,214,639,331.99	92.67%

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	南方佳元6个月持有债券A	3,385,764.74	1.0681%
	南方佳元6个月持有债券C	119.97	0.0000%
	合计	3,385,884.71	0.2583%

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	南方佳元 6 个月持有债券 A	>100
	南方佳元 6 个月持有债券 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	南方佳元 6 个月持有债券 A	10~50
	南方佳元 6 个月持有债券 C	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方佳元 6 个月持有债券 A	南方佳元 6 个月持有债券 C
基金合同生效日(2021 年 6 月 21 日)基金份额总额	245,720,713.38	79,344,891.71
本报告期期初基金份额总额	221,793,523.73	803,445,629.76
本报告期基金总申购份额	174,142,880.47	641,740,173.87
减：报告期基金总赎回份额	78,934,492.95	451,483,101.79
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	317,001,911.25	993,702,701.84

## § 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	4	290,404,132.97	100.00%	189,391.62	100.00%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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：

华泰证券

退租交易单元：

中信证券

华泰证券

### 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
华泰证券	299,846,541.99	100.00%	2,204,991,000.00	100.00%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 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调整旗下部分基金单笔赎回最低份额限制的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-06
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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-28
3	关于南方佳元6个月持有期债券型证券投资基金转换证券交易模式有关事项的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-23
4	关于南方佳元6个月持有期债券型证券投资基金变更基金经理的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-02
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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-15

6	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	证券日报、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佳元 6 个月持有期债券型证券投资基金的文件；
- 2、《南方佳元 6 个月持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方佳元 6 个月持有期债券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、《南方佳元 6 个月持有期债券型证券投资基金 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>