

南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 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。

本年度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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 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。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	18
§5 托管人报告.....	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 审计报告.....	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表.....	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	22
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告.....	58
8.1 期末基金资产组合情况.....	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	59
8.3 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.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70
8.6 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.....	70

8.7	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	71
8.8	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	71
8.9	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	71
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	71
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
8.12	投资组合报告附注	72
§9	基金份额持有人信息	72
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
9.3	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	73
9.4	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	73
§10	开放式基金份额变动	74
§11	重大事件揭示	74
11.1	基金份额持有人大会决议	74
11.2	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	74
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4	基金投资策略的改变	74
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	74
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	75
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8	其他重大事件	77
§12	影响投资者决策的其他重要信息	83
12.1	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	83
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	83
§13	备查文件目录	83
13.1	备查文件目录	83
13.2	存放地点	84
13.3	查阅方式	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金	
基金简称	南方潜力新蓝筹混合	
基金主代码	000327	
交易代码	000327	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 5 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,507,300,877.59 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方潜力新蓝筹混合 A	南方潜力新蓝筹混合 C
下属分级基金的交易代码	000327	015396
报告期末下属分级基金的份 额总额	745,765,628.09 份	761,535,249.50 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，采用定量和定性的投资方法，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金所指的潜力新蓝筹股票是指中小市值上市公司中业绩优良、发展稳定、红利优厚、品牌价值逐渐显现的上市公司股票。本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，定期或不定期地进行调整，以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	80%×中证 700 指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，一般而言，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金。本基金主要投资于中小市值股票,在混合型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。前款有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同。本基金的风险等级可能有相应变化，具体风险评级结果应以销售机构的评级结果为准。

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	中国建设银行股份有限公司
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
客户服务电话	400-889-8899	021-60637228
传真	0755-82763889	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518017	100033
法定代表人	周易	田国立

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

1、南方潜力新蓝筹混合 A

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-143,091,308.88	48,754,927.75	56,243,910.39
本期利润	-242,400,221.92	38,291,947.73	58,729,303.80
加权平均基金份额本期利润	-0.5757	0.5209	0.6321
本期加权平均净值利润率	-24.94%	21.20%	34.81%
本期基金份额净值增长率	-14.50%	24.05%	43.23%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	663,868,881.69	141,627,948.12	86,242,134.72
期末可供分配基金份额利润	0.8901	1.7032	1.0875
期末基金资产净值	1,531,915,482.51	224,778,216.23	172,810,867.87
期末基金份额净值	2.0542	2.7033	2.1792
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	107.84%	143.10%	95.97%

2、南方潜力新蓝筹混合 C

3.1.1 期间数据和指标	2022 年 3 月 16 日-2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-29,460,330.85
本期利润	-239,195,971.14
加权平均基金份额本期利润	-0.6798
本期加权平均净值利润率	-29.37%
本期基金份额净值增长率	-3.39%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末
期末可供分配利润	667,678,667.29
期末可供分配基金份额利润	0.8767
期末基金资产净值	1,554,068,910.74
期末基金份额净值	2.0407
3.1.3 累计期末指标	2022 年末
基金份额累计净值增长率	-3.39%

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

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

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

4、本基金从 2022 年 3 月 16 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2022 年 3 月 16 日起存续。

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

南方潜力新蓝筹混合 A

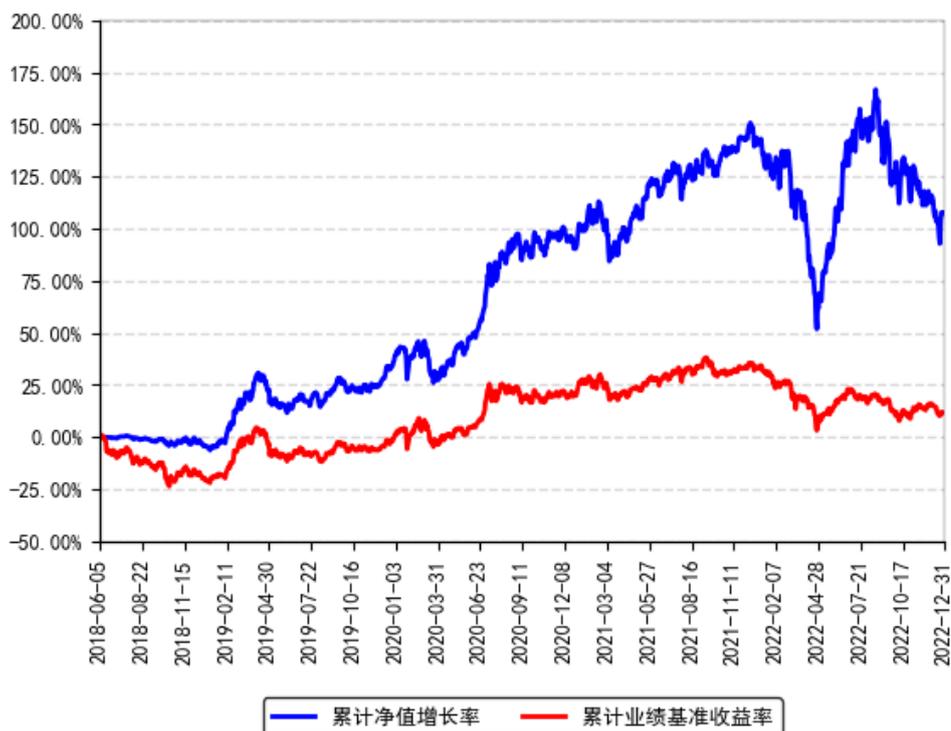
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.57%	1.83%	2.15%	0.84%	-6.72%	0.99%
过去六个月	-11.95%	2.00%	-8.67%	0.84%	-3.28%	1.16%
过去一年	-14.50%	2.20%	-16.95%	1.05%	2.45%	1.15%
过去三年	51.90%	1.67%	11.90%	1.08%	40.00%	0.59%
自基金合同生效起至今	107.84%	1.46%	11.62%	1.12%	96.22%	0.34%

南方潜力新蓝筹混合 C

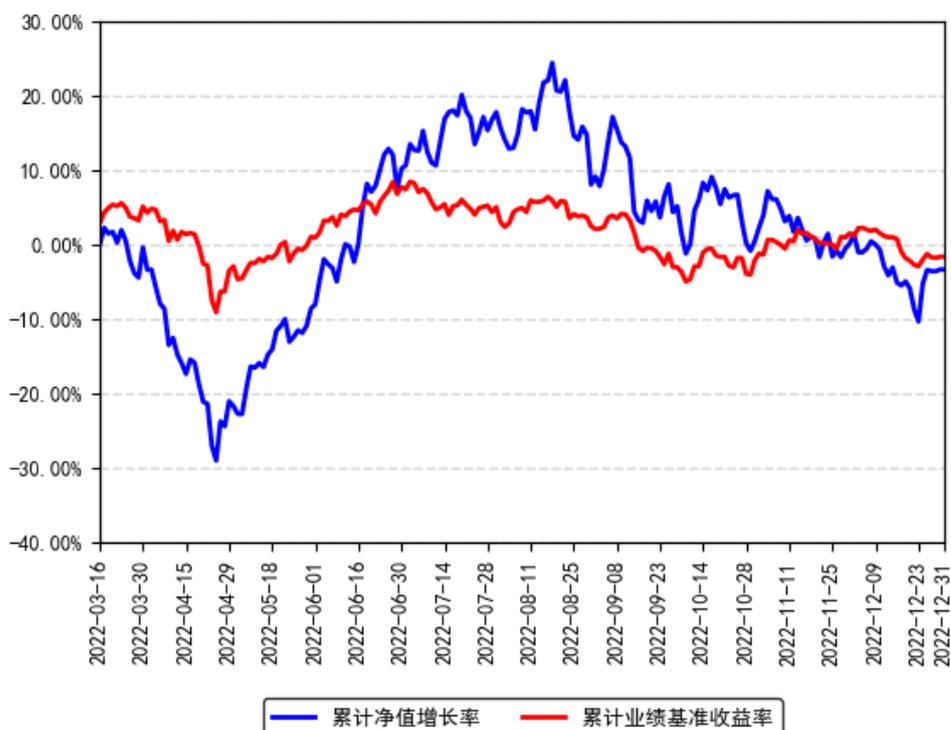
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.76%	1.83%	2.15%	0.84%	-6.91%	0.99%
过去六个月	-12.30%	2.00%	-8.67%	0.84%	-3.63%	1.16%
自基金合同生效起至今	-3.39%	2.20%	-1.66%	1.03%	-1.73%	1.17%

3.2.2 自基金转型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

南方潜力新蓝筹混合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



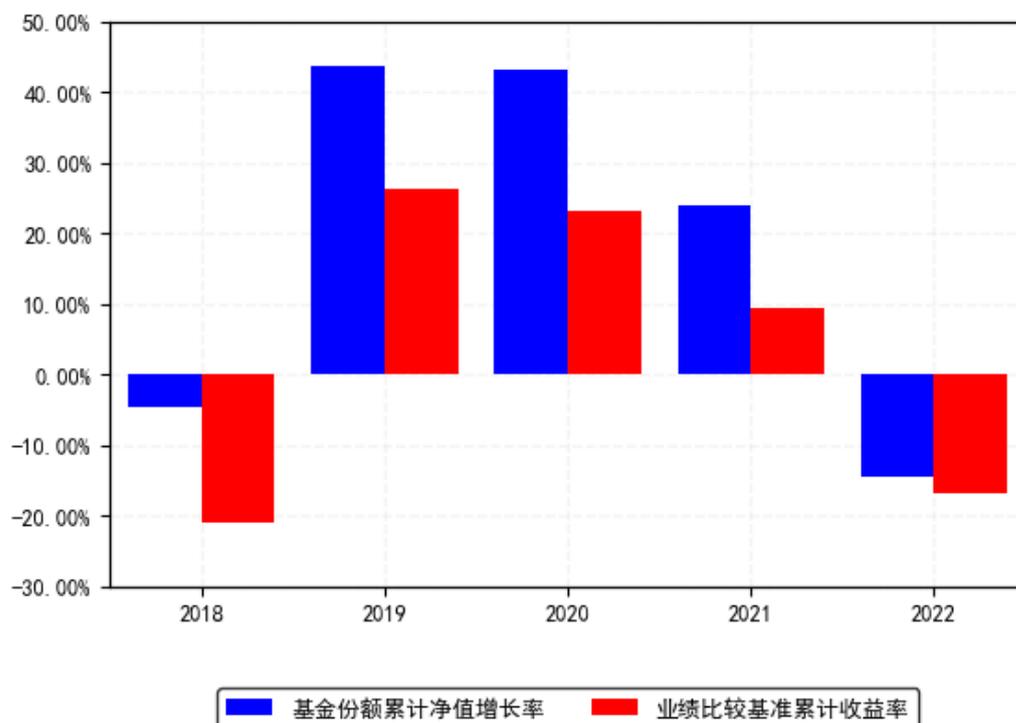
南方潜力新蓝筹混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



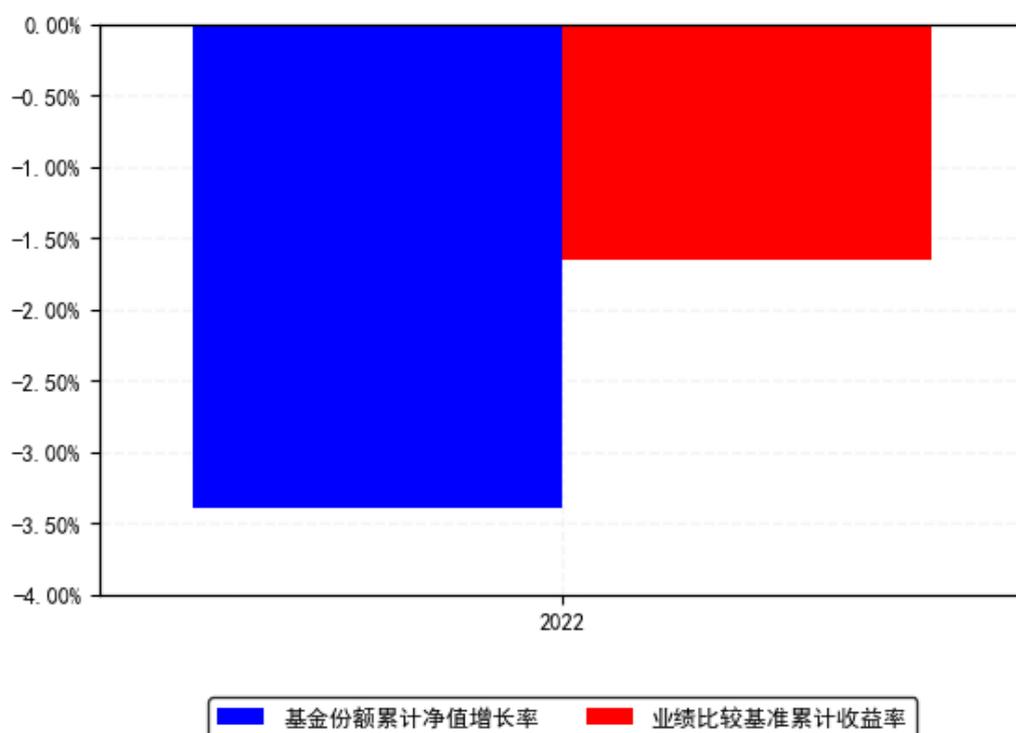
注：本基金从2022年3月16日起新增C类份额，C类份额自2022年3月16日起存续。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方潜力新蓝筹混合A每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



南方潜力新蓝筹混合C每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

南方潜力新蓝筹混合 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	2.3010	96,844,605.4 5	19,624,190.0 7	116,468,795. 52	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	2.3010	96,844,605.4 5	19,624,190.0 7	116,468,795. 52	-

南方潜力新蓝筹混合 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	2.3010	56,533,605.3 8	18,086,916.0 8	74,620,521.4 6	-
合计	2.3010	56,533,605.3 8	18,086,916.0 8	74,620,521.4 6	-

§ 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 1.72 万亿元，旗下管理 317 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		
钟贇	本基金基金经理	2022 年 1 月 5 日	-	11 年	北京大学西方经济学硕士，具有基金从业资格。曾任国泰基金研究部行业研究员、招商基金研究部高级研究员兼中游制造组组长、投资四部基金经理。2017 年 2 月 22 日至 2019 年 3 月 23 日，任招商优势企业、招商移动互联网基金经理；2017 年 12 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日，任招商安润基金经理；2020 年 1 月 4 日至 2021 年 9 月 28 日，任招商稳健优选基金经理。2021 年 9 月加入南方基金，2022 年 1 月 5 日至今，任南方新蓝筹混合基金经理；2022 年 8 月 16 日至今，兼任投资经理。
吴剑毅	本基金基金经理（已离任）	2019 年 1 月 25 日	2022 年 1 月 5 日	14 年	清华大学金融学硕士，具有基金从业资格。2009 年 7 月加入南方基金，任南方基金研究部金融行业研究员；2012 年 3 月 15 日至 2014 年 7 月 18 日，担任南方避险、南方保本基金基金经理助理；2015 年 11 月 26 日至 2017 年 12 月 2 日，任南方顺康保本基金基金经理；2014 年 7 月 18 日至 2018 年 1 月 16 日，任南方恒元基金经理；2015 年 9 月 11 日至 2018 年 11 月 28 日，任南方消费活力基金经理；2015 年 10 月 28 日至 2018 年 11 月 3 日，任南方顺达保本基金基金经理；2017 年 8 月 3 日至 2019 年 1 月 25 日，任南方金融混合基金经理；2017 年 12 月 2 日至 2020 年 5 月 15 日，任南方顺康混合基金经理；2018 年 2 月 6 日至 2020 年 5 月 15 日，任南方安养混合基金经理；2019 年 1 月 25 日至 2022 年 1 月 5 日，任南方新蓝筹混合基金经理；2015 年 5 月 21 日至今，任南方利众基金经理；2015 年 7 月 8 日至今，任南方利达基金经理；2015 年 11 月 19 日至今，任南方利安基金经理；2016 年 12 月 14 日至今，任南方安颐混合基金经理；2017 年 11 月 2 日至今，任南方安福混合基金经理；2018 年 11 月 3 日至今，任南方中小盘成长股票基金经理；2020 年 4 月 29 日至今，任南方誉慧一年混合基金

					经理；2020 年 11 月 18 日至今，任南方誉鼎一年持有期混合基金经理 2022 年 8 月 2 日至今，任南方宝祥混合基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
钟贇	公募基金	1	3,085,984,393.25	2017 年 02 月 22 日
	私募资产管理计划	2	793,471,745.10	2022 年 09 月 19 日
	其他组合	-	-	-
	合计	3	3,879,456,138.35	-

4.1.4 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由工资、奖金等构成。工资由基金经理任职的职位职级决定，重点体现员工能力和职位价值导向原则；奖金由员工的绩效贡献决定，重点体现绩效导向与差异化原则。对于兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理，公司对私募资产管理计划产生的超额业绩报酬实施对应激励，并依据其管理产品的长期业绩与个人综合贡献情况实施分配。为贯彻激励约束相结合、激励与约束并重的管理理念，鼓励长期任职，防范经营风险，公司对基金经理奖金实施递延发放。同时，为加强员工利益与持有人利益相捆绑及一致性，公司对基金经理实施了跟投购基机制，有效引导基金经理为客户持续创造价值。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分

析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立和完善了兼任相关的制度及流程，确保兼任基金经理公平对待其管理的所有投资组合。通过对基金经理的投资交易行为进行监控和分析，本报告期内，两两组合间各项操作、流程及事后分析均正常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 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12次，是由于投资组合的投资策略导致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年黑天鹅事件频发，行情跌宕起伏，我们还是坚持自己的投资框架，从中观行业出发挖掘可持续发展的行业，重点布局了风电、储能等板块，另外从九月开始配置医药，虽然全年同业排名还可以，中间也一度获得了正收益，但最终还是没能守住，全年下来没能给投资者带来正收益，还是有些遗憾。

报告期内的运作分析：

(1) 22年1-4月：

先后因为美联储加息、俄乌冲突、上海疫情等连续黑天鹅事件，市场风险偏好持续降低，悲观情绪浓厚，成长股被集体杀估值，不区分基本面无差别杀伤，新蓝筹因为整体偏向成长，且以新能源为主，期间受伤严重，也经历了大幅回撤，但当时冷静分析下来一方面新能源的基本面在这些黑天鹅事件中都没有受损，甚至还因为俄乌冲突得到进一步加强（欧洲因为担心能源安全而大幅提高新能源建设规划，同时欧洲户用储能市场开始爆发），基本面还是很强劲，而在极端的风险厌恶下市场进入了非理性状态，对成长无差别杀伤把新能源估值又杀到了极低，历史上这种非理性状态持续时间往往不会太久，因为明显跌过头后总有聪明的钱会开始抄底，同时大幅下跌后继续下跌的动能会较快开始衰竭（因为下跌幅度已足够大），所以在基本面强劲和判断非理性状态无法持续过久的情况下，还是坚持了对新能源的持仓，并没有做切换，为后面的反弹奠定了基础。

(2) 22 年 5-8 月：

因为上海疫情开始缓解（日新增病例不断下降），同时江浙沪企业开始积极复工复产，叠加国家出台汽车刺激政策并开始释放一系列稳增长信号，市场出现大幅反弹，反弹主线就是能源，包括旧能源（煤炭）和新能源，两者都是俄乌冲突爆发后基本面进一步强化的，同时受疫情影响也小，有相对独立的逻辑，于是在当时看未来疫情仍有不确定性的情况下，能源成为逻辑最顺的板块，扮演了反弹主力。我们因为坚持了对新能源的持仓，且在反弹中中间抓住了电动车、光伏、储能、风电等的轮动机会以及部分弹性标的，因此这一波反弹还是做得相对出色，底部起来最大反弹幅度达到 75.7%。

(3) 22 年 9-12 月：

九月美国通胀超预期，美联储加息态度异常强硬，美债收益率也不断攀升，同时国内疫情又开始有多点爆发的情况，于是市场风险偏好又开始持续回落，有点 1-4 月情况重演一遍的意思。期间主要是自主可控（半导体、信创）、中药、军工等领涨，而前期强势的能源主线开始明显补跌。11 月因为地产政策、防疫政策先后出现重大转向，于是地产产业链、旅游出行、大消费等先后成为 11-12 月的上涨主线。我们从九月开始加配医药，一开始主要是觉得 9 月集采政策转向会带来明显的估值修复，毕竟之前医药估值被杀得够低了，11 月疫情管控放开后医药因为能受益就诊人次的恢复，基本面又得到进一步加强。因此四季度虽然新能源回调幅度较大，但及时配置医药让我们总体回撤幅度还是得到了一定的控制。没有从新能源切向疫后复苏主要是觉得主要持仓的风电储能基本面其实没有实质性利空，还是很强劲，只是因为其它板块边际变化更大，被资金抽水导致短期下跌，一旦风险偏好修复的话，还是会出现估值修复，而复苏板块在一到两个季度内业绩支撑还不会很强，因此也没有必要一味追涨杀跌，可以等待更好的机会再布局，但没有意料到的是弱市下短期资金的跷跷板效应远超预期，因此四季度组合还是承受了较大压力。

(4) 反思：

虽然 22 年全年跌幅比同业中位数还是要好一些，但是其实还是有不少值得反思以及进一步改进的方面，尤其是今年的两波较大回撤，其实是创了自己管理基金以来的最大回撤幅度，有不少值得深思的地方，尤其是在弱市环境中遇到一些突发事件时的应对，有很多教训可以吸取，希望未来在面临 22 年 1-4 月和 9-12 月的类似情况时，可以应对得更好。

首先在弱市中若碰到重大黑天鹅（类似今年三四月的俄乌冲突、上海疫情），要特别警惕，可能引发市场雪崩，其中高景气的成长股往往更是跌幅巨大（因为之前市场预期较高，在突发黑天鹅状况下市场容易陷入极度悲观进而认为当前的高景气会没法持续进而业绩下修幅度比非景气板块更大，所以高景气反而跌幅大），这种情况最好是降仓，而且要快，因为容易短期杀伤幅度巨大，进而给持有人带来很大压力；其次弱市时若其它行业出现重大边际利好，即使说短期不一定能兑现业绩，但只要方向变了，也会引起市场风格的重大转向同时原有的强势板块可能还会被严重抽水形成大幅下跌，如 10 月开始的地产链、疫后复苏链的重大边际利好导致了新半军等板块的集体大跌，所以弱市时对出现重大边际利好的行业短期还是要考虑进行一定比例的仓位配置，即使你觉得长期空间未必很大或者未必能超过现有持仓公司，但不可证伪时阶段性还是会较为强势逼空并对原有持仓形成巨大压力，因为弱市环境下资金的跷跷板效应可能会远超你预期，这也是值得警惕的。

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 2.0542 元，报告期内，份额净值增长率为-14.50%，同期业绩基准增长率为-16.95%；本基金 C 份额净值为 2.0407 元，报告期内，份额净值增长率为-3.39%，同期业绩基准增长率为-1.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济基本面角度 2022 年是在众多黑天鹅事件叠加之下形成了国内明显低于其潜在增长率的经济增速，2023 年在去年的低基数上出现一定的经济复苏是极大概率事件，只是经济复苏能到怎样的高度是需要进一步跟踪和观察的。流动性角度国内的货币环境不太可能在复苏早期就开始收紧，还是会维持相对宽松，而国外来看美联储加息也进入尾声，所以今年国内外的货币环境都会相对宽松，对权益市场的估值形成支撑。因此经济基本面和货币流动性都是对权益市场相对利好的，这样多因素共振之下今年 A 股出现上涨的概率还是相对较高的，即胜率较高。

另外主要板块的估值也都处于各自历史估值较低的百分位，当下的估值水平已经蕴含了非常多市场之前的悲观预期，向下空间相对有限，但一旦有些催化剂，向上的弹性都还比较大，所以当下的大盘位置赔率也是较高的。

综上，无论从赔率还是胜率的角度，当下的权益市场其实都处于挺不错的布局时点。

行业结构方面我们认为 2023 年决定行业配置的关键是观察经济复苏的高度，若复苏持续超预期，那么顺周期当中利润弹性大的板块会有较大的机会；若复苏较为温和，那么成长板块可能占主导；若复苏严重不及预期，那么稳增长的板块可能又会有机会。我们会根据后期的经济数据进行相应的应对，对基金经理来说，很多时候应对其实比预判更加重要。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况，严格遵循包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求，有效落实了 2022 年度发布的《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《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》和《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》等公募基金相关新法律法规。

本基金管理人坚持从保护基金份额持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础、合规为先、行稳致远”的合规理念，继续致力于合规与内控机制的完善，严守底线，通过有效过程管控，将合规管理全面深度嵌入流程与业务，积极推动主动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，制订和修订了包括《合规手册制度》《防控内幕信息及交易管理制度》《合规绩效管理制度》《责任追究管理办法》《洗钱及制裁风险名单管理规定》和《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理规则》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在进一步优化制度体系的基础上，本基金管理人贯彻“合规为先，行稳致远”的合规理念，提升合规文化建设效果，着力增强合规培训实效性，提升合规宣导影响力；根据《基金从业人员管理规则》等监管办法要求，认真梳理并优化了员工行为检查工作方案，加强员工行为规范检查、严格进行合规问责，强化全员合规、主动合规理念；对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展了定期稽核、专项稽核及多项自查，通过专项稽核和合规检查工作识别问题、防范风险、推动解决，促进公司业务合规运作、稳健经营；结合内部风控系统大数据分析结果对各类合规指标采取差异化管控措施，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料以及包括网络直播脚本在内的其他宣传材料合规性，不断强化销售合规风险管控，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；开展各类

监管组织的投教活动，提升投教质效；监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱相关工作，贯彻风险为本，自评估驱动，反洗钱重点问题解决方案实现落地推进。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程，有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全全部管理制度，不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性，持续全面推进合规数智化工作在更广范围应用并与合规管理工作深度融合，努力防范和管理各类风险，切实维护基金资产的安全与利益。

4.7 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、现金及债券指数投资部总经理、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金进行了收益分配，符合法律法规和基金合同约定。具体如下：

A 类份额：

权益登记日 2022 年 4 月 25 日，每 10 份基金份额分红数 1.2410。

权益登记日 2022 年 12 月 6 日，每 10 份基金份额分红数 1.0600。

C 类份额：

权益登记日 2022 年 4 月 25 日，每 10 份基金份额分红数 1.2410。

权益登记日 2022 年 12 月 6 日，每 10 份基金份额分红数 1.0600。

4.9 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 27510 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金全体基金份额持有人

审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金(以下简称“南方潜力新蓝筹混合基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了南方潜力新蓝筹混合基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于南方潜力新蓝筹混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>南方潜力新蓝筹混合基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估南方潜力新蓝筹混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算南方潜力新蓝筹混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南方潜力新蓝筹混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇</p>

	<p>总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对南方潜力新蓝筹混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致南方潜力新蓝筹混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张振波 陈薇瑶
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31	上年度末 2021 年 12 月
----	-----	--------------------	------------------

		日	31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	74,449,407.62	7,644,562.88
结算备付金		5,151,864.36	639,602.95
存出保证金		818,955.75	55,192.16
交易性金融资产	7.4.7.2	3,016,883,477.39	214,653,028.23
其中：股票投资		2,853,326,840.50	203,183,126.33
基金投资		-	-
债券投资		163,556,636.89	11,469,901.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		209,808.42	2,823,539.64
应收股利		-	-
应收申购款		1,708,112.65	478,018.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	221,492.12
资产总计		3,099,221,626.19	226,515,436.10
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	262,631.29
应付赎回款		4,199,706.99	564,592.23
应付管理人报酬		3,978,877.95	285,442.71
应付托管费		663,146.28	47,573.77
应付销售服务费		1,008,977.21	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	3,386,524.51	576,979.87

负债合计		13,237,232.94	1,737,219.87
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	1,507,300,877.59	83,150,268.11
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	1,578,683,515.66	141,627,948.12
净资产合计		3,085,984,393.25	224,778,216.23
负债和净资产总计		3,099,221,626.19	226,515,436.10

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，南方潜力新蓝筹混合 A 份额净值 2.0542 元，基金份额总额 745,765,628.09 份；南方潜力新蓝筹混合 C 份额净值 2.0407 元，基金份额总额 761,535,249.50 份；总份额合计 1,507,300,877.59 份。

7.2 利润表

会计主体：南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-448,503,931.88	44,310,165.91
1.利息收入		294,438.58	341,269.15
其中：存款利息收入	7.4.7.9	294,438.58	41,771.84
债券利息收入		-	299,497.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-144,308,005.06	54,228,522.66
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-153,985,125.53	52,654,622.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	5,607,858.22	-425.63
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	4,069,262.25	1,574,325.42
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）	7.4.7.16	-309,044,553.33	-10,462,980.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,554,187.93	203,354.12
减：二、营业总支出		33,092,261.18	6,018,218.18
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	23,788,155.63	2,701,293.00
2.托管费	7.4.10.2.2	3,964,692.61	450,215.54
3.销售服务费	7.4.10.2.3	5,073,533.60	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		10,345.06	487.52
其中：卖出回购金融资产支出		10,345.06	487.52
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		12.47	0.17
8.其他费用	7.4.7.18	255,521.81	2,866,221.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-481,596,193.06	38,291,947.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-481,596,193.06	38,291,947.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-481,596,193.06	38,291,947.73

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	83,150,268.11	-	141,627,948.12	224,778,216.23
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）	83,150,268.11	-	141,627,948.12	224,778,216.23

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,424,150,609.48	-	1,437,055,567.54	2,861,206,177.02
（一）、综合收益总额	-	-	-481,596,193.06	-481,596,193.06
（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）	1,424,150,609.48	-	2,109,741,077.58	3,533,891,687.06
其中：1.基金申购款	2,281,991,107.45	-	3,155,379,839.22	5,437,370,946.67
2.基金赎回款	-857,840,497.97	-	-1,045,638,761.64	-1,903,479,259.61
（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）	-	-	-191,089,316.98	-191,089,316.98
（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）	1,507,300,877.59	-	1,578,683,515.66	3,085,984,393.25
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	79,298,719.96	-	93,512,147.91	172,810,867.87
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）	79,298,719.96	-	93,512,147.91	172,810,867.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,851,548.15	-	48,115,800.21	51,967,348.36
（一）、综合收益总额	-	-	38,291,947.73	38,291,947.73
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	3,851,548.15	-	9,823,852.48	13,675,400.63

(净值减少以“-”号填列)				
其中: 1.基金申购款	44,062,860.13	-	66,390,860.65	110,453,720.78
2.基金赎回款	-40,211,311.98	-	-56,567,008.17	-96,778,320.15
(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)	83,150,268.11	-	141,627,948.12	224,778,216.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金是根据原南方丰合保本混合型证券投资基金(以下简称“南方丰合保本混合基金”)《南方丰合保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,由南方丰合保本混合基金转型而来。原南方丰合保本混合基金为契约型开放式基金,存续期限不定,南方丰合保本混合基金第一个保本期于 2018 年 5 月 29 日到期,但基金管理人无法为南方丰合保本混合基金转入下一保本期确定保本担保人,南方丰合保本混合基金不能满足继续作为法律法规规定的避险策略型基金运作的条件,基金管理人经与托管人协商一致,根据《南方丰合保本混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为非保本的混合型基金,即自 2018 年 6 月 5 日起,南方丰合保本混合基金转型为南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),《南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2022 年 3 月 15 日发布的《关于南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修订相关法律文件的公告》以及更新后的《南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,自 2022 年 3 月 16 日

起,本基金增设 C 类基金份额,原基金份额转换为 A 类基金份额。本基金对不同类别的份额设置不同的认购/申购费用、销售服务费收取方式。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用,且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费,且不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金可以投资于 A 股股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证)、债券、中期票据、银行存款等货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券及中国证监会允许投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为:股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例为 60%-95%,其中投资于潜力新蓝筹股票的资产合计不低于非现金资产的 80%;债券、中期票据、权证、货币市场工具、资产支持证券及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 5%-40%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券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、应收申购款等,基金持有权证的市场价值不得超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为: $80\% \times \text{中证 700 指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2023 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当

期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移

给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现

平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期

评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号)，中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第

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

(a) 金融工具

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

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 7,644,562.88 元、639,602.95 元、55,192.16 元、221,492.12 元、2,823,539.64 元和 478,018.12 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 7,645,401.26 元、639,919.53 元、55,219.55 元、0.00 元、2,823,539.64 元和 478,018.12 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 214,653,028.23 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 214,873,338.00 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 262,631.29 元、564,592.23 元、285,442.71 元、47,573.77 元、415,564.59 元和 1,415.28 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 262,631.29 元、564,592.23 元、285,442.71 元、47,573.77 元、415,564.59 元和 1,415.28 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	74,449,407.62	7,644,562.88
等于：本金	74,439,330.56	7,644,562.88
加：应计利息	10,077.06	-
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	74,449,407.62	7,644,562.88

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	3,166,507,564.75	-	2,853,326,840.50	-313,180,724.25	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	161,778,743.04	2,293,109.89	163,556,636.89	-515,216.04
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	161,778,743.04	2,293,109.89	163,556,636.89	-515,216.04
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	3,328,286,307.79	2,293,109.89	3,016,883,477.39	-313,695,940.29	
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	

股票		207,807,394.19	-	203,183,126.33	-4,624,267.86
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	11,497,021.00	-	11,469,901.90	-27,119.10
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	11,497,021.00	-	11,469,901.90	-27,119.10
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		219,304,415.19	-	214,653,028.23	-4,651,386.96

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	221,492.12
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	221,492.12

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4,040.48	1,415.28
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	3,172,484.03	415,564.59
其中：交易所市场	3,172,484.03	415,564.59
银行间市场	-	-

应付利息	-	-
预提费用	210,000.00	160,000.00
其他	-	-
合计	3,386,524.51	576,979.87

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方潜力新蓝筹混合 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	83,150,268.11	83,150,268.11
本期申购	1,059,055,029.19	1,059,055,029.19
本期赎回（以“-”号填列）	-396,439,669.21	-396,439,669.21
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	745,765,628.09	745,765,628.09

南方潜力新蓝筹混合 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	1,222,936,078.26	1,222,936,078.26
本期赎回（以“-”号填列）	-461,400,828.76	-461,400,828.76
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	761,535,249.50	761,535,249.50

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

南方潜力新蓝筹混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	146,196,628.42	-4,568,680.30	141,627,948.12
本期利润	-143,091,308.88	-99,308,913.04	-242,400,221.92
本期基金份额交易产生的变动数	777,232,357.67	226,158,566.07	1,003,390,923.74
其中：基金申购款	1,198,609,692.75	284,861,465.65	1,483,471,158.40
基金赎回款	-421,377,335.08	-58,702,899.58	-480,080,234.66
本期已分配利润	-116,468,795.52	-	-116,468,795.52

本期末	663,868,881.69	122,280,972.73	786,149,854.42
-----	----------------	----------------	----------------

南方潜力新蓝筹混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-29,460,330.85	-209,735,640.29	-239,195,971.14
本期基金份额交易产生的变动数	771,759,519.60	334,590,634.24	1,106,350,153.84
其中：基金申购款	1,225,145,910.66	446,762,770.16	1,671,908,680.82
基金赎回款	-453,386,391.06	-112,172,135.92	-565,558,526.98
本期已分配利润	-74,620,521.46	-	-74,620,521.46
本期末	667,678,667.29	124,854,993.95	792,533,661.24

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	170,291.95	29,836.77
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	66,048.36	10,719.85
其他	58,098.27	1,215.22
合计	294,438.58	41,771.84

7.4.7.10 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,782,437,981.71	886,223,035.94
减：卖出股票成本总额	2,924,943,497.44	833,568,413.07
减：交易费用	11,479,609.80	-
买卖股票差价收入	-153,985,125.53	52,654,622.87

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	1,867,949.09	-
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收	3,739,909.13	-425.63

入		
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	5,607,858.22	-425.63

7.4.7.11.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	136,678,161.98	18,471,728.56
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	130,658,704.26	17,879,068.96
减：应计利息总额	2,279,019.62	593,085.23
减：交易费用	528.97	-
买卖债券差价收入	3,739,909.13	-425.63

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	4,069,262.25	1,574,325.42
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	4,069,262.25	1,574,325.42

7.4.7.16 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-309,044,553.33	-10,462,980.02
——股票投资	-308,556,456.39	-10,595,373.18
——债券投资	-488,096.94	132,393.16
——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	-309,044,553.33	-10,462,980.02

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	4,282,463.64	157,853.35
基金转换费收入	271,724.29	45,500.77
合计	4,554,187.93	203,354.12

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中 A 类份额将不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产，C 类份额将赎回费收入全额归入基金资产。

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，A 类份额将不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产，C 类份额将转出基金的赎回费全额归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	37,200.00	37,200.00
银行费用	8,321.81	7,376.23
交易费用	-	2,661,645.72
合计	255,521.81	2,866,221.95

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	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
厦门国际信托有限公司("厦门国际信托")	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司("深圳投资控股")	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
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
南方资本管理有限公司("南方资本")	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司("南方东英")	基金管理人的子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	1,578,150,835.91	18.26%	-	-
兴业证券	771,834,772.11	8.93%	12,638,305.08	0.72%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	107,375,694.06	32.75%	-	-

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	10,000,000.00	7.42%	-	-

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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 12 月 31 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	1,453,936.94	18.29%	1,189,683.84	37.50%
兴业证券	709,141.33	8.92%	164,366.25	5.18%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	-	-	-	-
兴业证券	11,517.30	0.72%	5,434.86	1.31%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	23,788,155.63	2,701,293.00
其中：支付销售机构的客户维护费	4,408,291.72	1,023,954.31

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,964,692.61	450,215.54

注：支付基金托管人中国建设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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方潜力新蓝筹混合 A	南方潜力新蓝筹混合 C	合计
华泰证券	-	1,879.91	1,879.91
南方基金	-	2,009,517.97	2,009,517.97
合计	-	2,011,397.88	2,011,397.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方潜力新蓝筹混合 A	南方潜力新蓝筹混合 C	合计
华泰证券	-	-	-
南方基金	-	-	-
合计	-	-	-

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 0.80% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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 12 月 31 日	
	南方潜力新蓝筹混合 A	南方潜力新蓝筹混合 C
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	9,043,909.65	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,043,909.65	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.60%	-

项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	南方潜力新蓝筹混合 A	南方潜力新蓝筹混合 C
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份	-	-

额		
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	74,449,407.62	170,291.95	7,644,562.88	29,836.77

注：本基金由基金托管人中国建设银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 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 12 月 31 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	301327	华宝新能	网下申购	2,417	574,037.50
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	3,011	243,288.80
华泰联合	301195	北路智控	网下申购	3,300	234,861.00
华泰联合	301277	新天地	网下申购	4,384	118,368.00
华泰联合	688420	美腾科技	网下申购	2,408	117,895.68
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	1,714	97,492.32
华泰联合	301316	慧博云通	网下申购	3,584	27,238.40
华泰联合	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
兴业证券	301165	锐捷网络	网下申购	10,769	348,700.22
兴业证券	603280	南方路机	网下申购	363	8,621.25

上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	601728	中国电信	网下申购	562,873	2,549,814.69

华泰联合	113050	南银转债	配债	8,240	824,000.00
华泰联合	688246	嘉和美康	网下申购	3,046	120,317.00
华泰联合	688192	迪哲医药	网下申购	2,175	114,361.50
华泰联合	688236	春立医疗	网下申购	2,559	76,283.79
华泰联合	688105	诺唯赞	网下申购	1,317	72,435.00
华泰联合	301078	孩子王	网下申购	7,551	43,569.27
华泰联合	688161	威高骨科	网下申购	1,154	41,797.88
华泰联合	688613	奥精医疗	网下申购	2,458	40,384.94
华泰联合	688097	博众精工	网下申购	3,286	37,033.22
华泰联合	688633	星球石墨	网下申购	1,038	34,897.56
华泰联合	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合	688260	昀冢科技	网下申购	2,990	28,793.70
华泰联合	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16
华泰联合	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合	301033	迈普医学	网下申购	1,076	16,290.64
华泰联合	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
华泰联合	001234	泰慕士	网下申购	333	5,504.49
兴业证券	300941	创识科技	网下申购	2,659	56,663.29
兴业证券	688639	华恒生物	网下申购	1,762	40,807.92
兴业证券	688195	腾景科技	网下申购	2,518	34,244.80
兴业证券	688597	煜邦电力	网下申购	3,907	22,973.16
兴业证券	605298	必得科技	网下申购	391	6,252.09
兴业证券	605086	龙高股份	网下申购	443	5,696.98

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

单位：人民币元

南方潜力新蓝筹混合 A

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2022 年 4 月 25 日	-	2022 年 4 月 25 日	1.2410	26,606,152.13	2,294,788.34	28,900,940.47	-
2	2022 年 12 月 6 日	-	2022 年 12 月 6 日	1.0600	70,238,453.32	17,329,401.73	87,567,855.05	-
合计	-	-	-	2.3010	96,844,	19,624,	116,468	-

					605.45	190.07	,795.52	
--	--	--	--	--	--------	--------	---------	--

南方潜力新蓝筹混合 C

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2022 年 4 月 25 日	-	2022 年 4 月 25 日	1.2410	368,670.64	437,084.05	805,754.69	-
2	2022 年 12 月 6 日	-	2022 年 12 月 6 日	1.0600	56,164,934.74	17,649,832.03	73,814,766.77	-
合计	-	-	-	2.3010	56,533,605.38	18,086,916.08	74,620,521.46	-

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
301095	广立微	2022 年 7 月 28 日	6 个月	新股锁定期	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301165	锐捷网络	2022 年 11 月 14 日	6 个月	新股锁定期	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-
301195	北路智控	2022 年 7 月 25 日	6 个月	新股锁定期	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
301223	中荣股份	2022 年 10 月 13 日	6 个月	新股锁定期	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-
301230	泓博医药	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股锁定期	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301267	华夏眼科	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股锁定期	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301270	汉仪股份	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股锁定期	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-

301273	瑞晨环保	2022年10月11日	6个月	新股锁定期	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301277	新天地	2022年11月9日	6个月	新股锁定期	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301280	珠城科技	2022年12月19日	6个月	新股锁定期	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301283	聚胶股份	2022年8月26日	6个月	新股锁定期	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301297	富乐德	2022年12月23日	6个月	新股锁定期	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股锁定期	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股锁定期	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股锁定期	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301318	维海德	2022年8月3日	6个月	新股锁定期	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股锁定期	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301327	华宝新能	2022年9月8日	6个月	新股锁定期	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301356	天振股份	2022年11月3日	6个月	新股锁定期	63.00	43.33	614	38,682.00	26,604.62	-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股锁定期	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301365	矩阵股份	2022年11月14日	6个月	新股锁定期	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92	-
301366	一博科技	2022年9月	6个月	新股锁定期	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-

		19 日								
301367	怡和嘉业	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股锁定期	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94	-
301377	鼎泰高科	2022 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定期	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301388	欣灵电气	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股锁定期	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301391	卡莱特	2022 年 11 月 24 日	6 个月	新股锁定期	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	-
688376	美埃科技	2022 年 11 月 10 日	6 个月	新股锁定期	29.19	28.49	3,713	108,382.47	105,783.37	-
688392	骄成超声	2022 年 9 月 19 日	6 个月	新股锁定期	71.18	134.27	2,745	195,389.10	368,571.15	-
688419	耐科装备	2022 年 10 月 31 日	6 个月	新股锁定期	37.85	29.44	3,039	115,026.15	89,468.16	-
688420	美腾科技	2022 年 12 月 1 日	6 个月	新股锁定期	48.96	39.04	2,408	117,895.68	94,008.32	-
7.4.12.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：

1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300850	新强联	2022年12月30日	重大事项停牌	53.28	2023年1月10日	56.88	421,227	36,965,521.01	22,442,974.56	-

本基金截至 2022 年 12 月 31 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型证券投资基金，预期风险和收益水平高于债券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。

7.4.13.2 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建设银行，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。

于本年度末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(上年度末：同)。

7.4.13.3 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。

于本年度末，本基金所承担的全部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(净资产)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。

7.4.13.3.1 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%。于本年度末,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.77%。

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。于本年度末,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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、债券投资和应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	74,449,407.6 2	-	-	-	74,449,407.6 2
结算备付金	5,151,864.36	-	-	-	5,151,864.36
存出保证金	818,955.75	-	-	-	818,955.75
交易性金融 资产	163,556,636. 89	-	-	2,853,326,84 0.50	3,016,883,47 7.39
衍生金融资 产	-	-	-	-	-
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投 资	-	-	-	-	-
其他权益工 具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	209,808.42	209,808.42
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	197,722.80	-	-	1,510,389.85	1,708,112.65
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	244,174,587. 42	-	-	2,855,047,03 8.77	3,099,221,62 6.19
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融 负债	-	-	-	-	-
衍生金融负 债	-	-	-	-	-
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,199,706.99	4,199,706.99

应付管理人报酬	-	-	-	3,978,877.95	3,978,877.95
应付托管费	-	-	-	663,146.28	663,146.28
应付销售服务费	-	-	-	1,008,977.21	1,008,977.21
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,386,524.51	3,386,524.51
负债总计	-	-	-	13,237,232.94	13,237,232.94
利率敏感度缺口	244,174,587.42	-	-	2,841,809,805.83	3,085,984,393.25
上年度末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,644,562.88	-	-	-	7,644,562.88
结算备付金	639,602.95	-	-	-	639,602.95
存出保证金	55,192.16	-	-	-	55,192.16
交易性金融资产	11,469,901.90	-	-	203,183,126.33	214,653,028.23
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	-	-	-	2,823,539.64	2,823,539.64
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	3,323.00	-	-	474,695.12	478,018.12
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	221,492.12	221,492.12
资产总计	19,812,582.89	-	-	206,702,853.21	226,515,436.10
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	-	-	-	262,631.29	262,631.29
应付赎回款	-	-	-	564,592.23	564,592.23
应付管理人报酬	-	-	-	285,442.71	285,442.71
应付托管费	-	-	-	47,573.77	47,573.77
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	576,979.87	576,979.87
负债总计	-	-	-	1,737,219.87	1,737,219.87
利率敏感度缺口	19,812,582.89	-	-	204,965,633.34	224,778,216.23

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。

7.4.13.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-146,462.18	-9,701.09
2.市场利率平行下降25个基点	147,009.25	9,735.42	

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 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：股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例为 60%-95%，债券、中期票据、权证、货币市场工具、资产支持证券及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 5%-40%，基金持有权证的市场价值不得超过基金资产净值的 3%。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	2,853,326,840.50	92.46	203,183,126.33	90.39
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	2,853,326,840.50	92.46	203,183,126.33	90.39

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）

	1.沪深 300 上升 5%	140,828,856.57	9,226,241.81
	2.沪深 300 下降 5%	-140,828,856.57	-9,226,241.81

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	2,829,718,022.91	197,069,149.57
第二层次	185,999,611.45	11,560,460.33
第三层次	1,165,843.03	6,023,418.33
合计	3,016,883,477.39	214,653,028.23

7.4.14.2.2 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位:人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票	
期初余额	-	6,023,418.33	6,023,418.33
当期购买	-	2,000,000.46	2,000,000.46
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,611,117.79	2,611,117.79

转出第三层次	-	9,900,094.88	9,900,094.88
当期利得或损失总额	-	431,401.33	431,401.33
其中：计入损益的利得或损失	-	431,401.33	431,401.33
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,165,843.03	1,165,843.03
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	114,662.31	114,662.31
项目	上年度可比同期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	5,135,383.55	5,135,383.55
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	888,034.78	888,034.78
其中：计入损益的利得或损失	-	888,034.78	888,034.78
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	6,023,418.33	6,023,418.33
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	888,034.78	888,034.78

于本年度末，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于本年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,165,843.03	平均价格法	预期波动率	0.2127~2.475	负相关

		式期权模型		6	
--	--	-------	--	---	--

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	6,023,418.33	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1717~2.7417	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本年度末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	2,853,326,840.50	92.07
	其中：股票	2,853,326,840.50	92.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	163,556,636.89	5.28
	其中：债券	163,556,636.89	5.28
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	79,601,271.98	2.57
8	其他资产	2,736,876.82	0.09
9	合计	3,099,221,626.19	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	64,407,454.65	2.09
C	制造业	2,590,566,598.03	83.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	45,912,309.40	1.49
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	99,204.38	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	28,766,597.26	0.93
M	科学研究和技术服务业	123,508,079.58	4.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	66,597.20	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,853,326,840.50	92.46

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 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

金额单位：人民币元

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	603606	东方电缆	3,814,579	258,742,893.57	8.38
2	688063	派能科技	527,451	166,489,908.15	5.40
3	600522	中天科技	9,979,229	161,164,548.35	5.22
4	605117	德业股份	472,100	156,359,520.00	5.07
5	600487	亨通光电	10,207,880	153,730,672.	4.98

				80	
6	300438	鹏辉能源	1,965,181	153,264,466.19	4.97
7	300763	锦浪科技	797,732	143,631,646.60	4.65
8	300014	亿纬锂能	1,238,700	108,881,730.00	3.53
9	300750	宁德时代	224,200	88,204,764.00	2.86
10	002487	大金重工	1,959,900	81,081,063.00	2.63
11	002531	天顺风能	4,903,852	74,195,280.76	2.40
12	688390	固德威	208,366	67,320,970.94	2.18
13	601958	金铂股份	5,576,403	64,407,454.65	2.09
14	603236	移远通信	624,320	62,943,942.40	2.04
15	301155	海力风电	706,467	61,709,892.45	2.00
16	300568	星源材质	2,858,677	60,775,473.02	1.97
17	300443	金雷股份	1,306,300	52,617,764.00	1.71
18	301071	力量钻石	317,600	37,842,040.00	1.23
19	002812	恩捷股份	279,725	36,725,095.25	1.19
20	301018	申菱环境	1,045,800	35,818,650.00	1.16
21	002262	恩华药业	1,440,500	35,364,275.00	1.15
22	688131	皓元医药	321,591	34,854,032.58	1.13
23	300759	康龙化成	506,829	34,464,372.00	1.12
24	000963	华东医药	680,408	31,843,094.40	1.03
25	300725	药石科技	393,500	31,676,750.00	1.03
26	300990	同飞股份	344,460	31,648,984.80	1.03

27	688389	普门科技	1,771,522	31,586,237.2 6	1.02
28	300122	智飞生物	351,750	30,894,202.5 0	1.00
29	688658	悦康药业	1,589,707	30,713,139.2 4	1.00
30	000519	中兵红箭	1,558,200	30,603,048.0 0	0.99
31	300832	新产业	603,970	30,283,055.8 0	0.98
32	301080	百普赛斯	281,719	28,929,724.1 1	0.94
33	001228	永泰运	581,026	28,766,597.2 6	0.93
34	000661	长春高新	172,000	28,629,400.0 0	0.93
35	603985	恒润股份	1,124,150	27,766,505.0 0	0.90
36	603659	璞泰来	529,195	27,459,928.5 5	0.89
37	300630	普利制药	1,071,446	26,421,858.3 6	0.86
38	300450	先导智能	625,270	25,167,117.5 0	0.82
39	300569	天能重工	3,096,257	24,924,868.8 5	0.81
40	301235	华康医疗	674,717	24,134,627.0 9	0.78
41	300850	新强联	421,227	22,442,974.5 6	0.73
42	000729	燕京啤酒	1,816,000	19,285,920.0 0	0.62
43	603218	日月股份	841,800	17,088,540.0 0	0.55
44	002020	京新药业	1,265,100	15,408,918.0 0	0.50
45	300769	德方纳米	65,700	15,084,063.0 0	0.49
46	688295	中复神鹰	349,051	15,068,531.6 7	0.49
47	300684	中石科技	985,500	14,595,255.0 0	0.47
48	002727	一心堂	446,500	14,069,215.0 0	0.46

49	600566	济川药业	515,800	14,040,076.00	0.45
50	002709	天赐材料	317,400	13,921,164.00	0.45
51	605222	起帆电缆	507,400	13,821,576.00	0.45
52	688499	利元亨	66,262	10,428,313.56	0.34
53	600973	宝胜股份	1,998,900	9,534,753.00	0.31
54	688123	聚辰股份	88,374	8,943,448.80	0.29
55	300274	阳光电源	60,700	6,786,260.00	0.22
56	300298	三诺生物	195,700	6,600,961.00	0.21
57	688121	卓然股份	242,835	5,934,887.40	0.19
58	300129	泰胜风能	717,900	5,147,343.00	0.17
59	688265	南模生物	21,960	1,076,040.00	0.03
60	688475	萤石网络	20,526	532,239.18	0.02
61	688392	骄成超声	2,745	368,571.15	0.01
62	301280	珠城科技	2,783	132,065.20	0.00
63	688410	山外山	4,853	122,635.31	0.00
64	688376	美埃科技	3,713	105,783.37	0.00
65	688420	美腾科技	2,408	94,008.32	0.00
66	688419	耐科装备	3,039	89,468.16	0.00
67	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
68	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
69	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
70	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
71	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
72	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
73	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00
74	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
75	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
76	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
77	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00
78	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
79	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
80	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
81	301365	矩阵股份	516	12,316.92	0.00
82	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
83	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
84	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
85	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
86	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
87	301318	维海德	206	8,598.44	0.00

88	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
89	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
90	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
91	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
92	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	603606	东方电缆	268,221,014.65	119.33
2	002487	大金重工	218,992,753.86	97.43
3	600522	中天科技	206,690,353.02	91.95
4	688063	派能科技	198,424,502.53	88.28
5	300438	鹏辉能源	188,463,559.32	83.84
6	300763	锦浪科技	173,473,668.91	77.18
7	600487	亨通光电	172,621,397.61	76.80
8	002531	天顺风能	161,795,345.61	71.98
9	300850	新强联	158,481,447.41	70.51
10	605117	德业股份	154,561,037.77	68.76
11	300014	亿纬锂能	128,777,120.06	57.29
12	300750	宁德时代	112,087,651.53	49.87
13	603985	恒润股份	92,584,145.94	41.19
14	300568	星源材质	90,367,222.03	40.20
15	603236	移远通信	86,079,806.23	38.30
16	002812	恩捷股份	81,652,067.65	36.33
17	300610	晨化股份	78,629,374.37	34.98
18	601958	金铂股份	76,675,649.29	34.11
19	300569	天能重工	76,654,952.87	34.10
20	301155	海力风电	72,555,939.58	32.28
21	300443	金雷股份	65,572,737.86	29.17
22	688390	固德威	64,069,015.35	28.50
23	603659	璞泰来	62,354,146.49	27.74
24	300450	先导智能	60,279,695.59	26.82
25	000963	华东医药	54,334,326.78	24.17
26	002129	TCL 中环	50,768,157.07	22.59
27	000661	长春高新	48,201,006.74	21.44
28	300630	普利制药	47,802,895.58	21.27
29	002727	一心堂	47,538,763.53	21.15
30	300769	德方纳米	46,731,817.00	20.79
31	301071	力量钻石	46,339,175.71	20.62

32	603688	石英股份	46,148,913.70	20.53
33	002865	钧达股份	46,038,557.00	20.48
34	300759	康龙化成	45,671,346.57	20.32
35	300122	智飞生物	45,602,550.15	20.29
36	688680	海优新材	44,941,481.13	19.99
37	002262	恩华药业	44,724,102.14	19.90
38	301018	申菱环境	43,498,325.36	19.35
39	688388	嘉元科技	43,430,175.29	19.32
40	002850	科达利	43,319,613.00	19.27
41	000519	中兵红箭	42,645,084.30	18.97
42	300529	健帆生物	41,473,589.93	18.45
43	001228	永泰运	39,355,689.83	17.51
44	301080	百普赛斯	37,400,280.34	16.64
45	688389	普门科技	37,295,299.76	16.59
46	603185	上机数控	37,068,106.60	16.49
47	603658	安图生物	36,990,629.64	16.46
48	688131	皓元医药	36,665,059.43	16.31
49	688559	海目星	35,723,027.88	15.89
50	688658	悦康药业	35,110,277.85	15.62
51	688349	三一重能	34,604,043.13	15.39
52	300990	同飞股份	34,551,970.05	15.37
53	300725	药石科技	32,395,834.44	14.41
54	300832	新产业	32,306,152.44	14.37
55	301235	华康医疗	30,719,464.51	13.67
56	300760	迈瑞医疗	30,356,365.00	13.51
57	300207	欣旺达	30,258,408.49	13.46
58	600566	济川药业	30,198,709.58	13.43
59	603806	福斯特	30,139,706.40	13.41
60	688186	广大特材	29,623,701.18	13.18
61	601615	明阳智能	29,618,057.86	13.18
62	603063	禾望电气	29,348,361.76	13.06
63	688518	联赢激光	29,066,220.95	12.93
64	603026	胜华新材	28,734,868.94	12.78
65	600549	厦门钨业	25,581,188.67	11.38
66	300035	中科电气	24,681,393.15	10.98
67	688499	利元亨	24,325,566.38	10.82
68	300916	朗特智能	24,313,054.50	10.82
69	300861	美畅股份	23,469,980.74	10.44
70	300347	泰格医药	22,768,431.54	10.13
71	603822	嘉澳环保	22,520,573.00	10.02
72	605366	宏柏新材	22,220,484.10	9.89
73	002738	中矿资源	21,567,187.44	9.59
74	601218	吉鑫科技	21,067,579.00	9.37

75	002192	融捷股份	20,904,099.00	9.30
76	603218	日月股份	20,580,416.14	9.16
77	300382	斯莱克	19,539,259.02	8.69
78	688196	卓越新能	19,529,537.90	8.69
79	688032	禾迈股份	19,303,335.07	8.59
80	002466	天齐锂业	18,853,476.00	8.39
81	688348	昱能科技	18,641,405.00	8.29
82	688308	欧科亿	18,238,049.69	8.11
83	600732	爱旭股份	18,057,378.00	8.03
84	603667	五洲新春	17,506,860.92	7.79
85	601865	福莱特	17,461,758.00	7.77
86	002020	京新药业	17,065,051.16	7.59
87	000155	川能动力	16,323,831.46	7.26
88	002709	天赐材料	16,146,425.00	7.18
89	605222	起帆电缆	16,087,681.04	7.16
90	000729	燕京啤酒	15,439,657.03	6.87
91	300684	中石科技	15,315,586.10	6.81
92	688295	中复神鹰	15,109,149.17	6.72
93	300573	兴齐眼药	14,803,052.00	6.59
94	600995	南网储能	14,784,071.00	6.58
95	300482	万孚生物	14,772,207.84	6.57
96	688106	金宏气体	14,758,618.27	6.57
97	603212	赛伍技术	14,660,589.48	6.52
98	688123	聚辰股份	14,536,517.68	6.47
99	002057	中钢天源	14,463,729.00	6.43
100	003022	联泓新科	14,450,553.50	6.43
101	000657	中钨高新	14,187,680.00	6.31
102	688596	正帆科技	14,065,017.96	6.26
103	300718	长盛轴承	14,027,298.00	6.24
104	002006	精工科技	13,839,965.00	6.16
105	301327	华宝新能	13,292,352.53	5.91
106	688700	东威科技	13,114,200.21	5.83
107	300129	泰胜风能	13,026,503.00	5.80
108	603392	万泰生物	12,789,185.05	5.69
109	301101	明月镜片	12,554,150.07	5.59
110	002080	中材科技	12,157,106.86	5.41
111	002756	永兴材料	11,799,436.00	5.25
112	688778	厦钨新能	11,788,789.05	5.24
113	300421	力星股份	11,755,858.00	5.23
114	603938	三孚股份	11,340,149.65	5.05
115	000546	金圆股份	11,249,949.00	5.00
116	600973	宝胜股份	11,161,561.00	4.97
117	601888	中国中免	10,792,449.78	4.80

118	300073	当升科技	10,585,905.38	4.71
119	300776	帝尔激光	10,459,879.00	4.65
120	300567	精测电子	10,203,311.45	4.54
121	300068	南都电源	9,976,951.71	4.44
122	301206	三元生物	9,947,865.00	4.43
123	300260	新莱应材	9,888,818.74	4.40
124	000301	东方盛虹	9,671,652.00	4.30
125	688121	卓然股份	9,389,930.01	4.18
126	300707	威唐工业	9,333,854.00	4.15
127	002434	万里扬	8,346,396.00	3.71
128	300590	移为通信	8,204,472.29	3.65
129	002739	万达电影	8,166,995.00	3.63
130	600110	诺德股份	8,097,816.00	3.60
131	300463	迈克生物	8,045,499.00	3.58
132	300457	赢合科技	8,031,795.00	3.57
133	605305	中际联合	8,000,768.00	3.56
134	688299	长阳科技	7,866,141.70	3.50
135	002669	康达新材	7,504,391.00	3.34
136	300298	三诺生物	7,258,199.00	3.23
137	603982	泉峰汽车	7,134,264.00	3.17
138	002532	天山铝业	6,847,834.00	3.05
139	300700	岱勒新材	6,807,648.30	3.03
140	688768	容知日新	6,805,563.83	3.03
141	301063	海锅股份	6,451,899.75	2.87
142	300274	阳光电源	6,361,733.40	2.83
143	688005	容百科技	6,306,761.68	2.81
144	603997	继峰股份	6,220,750.00	2.77
145	688383	新益昌	6,217,977.46	2.77
146	300969	恒帅股份	6,002,354.00	2.67
147	002807	江阴银行	5,987,321.29	2.66
148	002839	张家港行	5,942,103.00	2.64
149	300587	天铁股份	5,622,198.00	2.50
150	002876	三利谱	5,299,981.00	2.36
151	600741	华域汽车	5,151,751.83	2.29
152	603338	浙江鼎力	5,131,179.00	2.28
153	601208	东材科技	5,059,816.00	2.25

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。

8.4.2 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	002487	大金重工	123,797,993.44	55.08
2	300850	新强联	122,502,588.26	54.50
3	300610	晨化股份	81,390,010.55	36.21
4	002531	天顺风能	62,175,623.18	27.66
5	603985	恒润股份	56,989,086.75	25.35
6	002727	一心堂	47,847,247.94	21.29
7	300438	鹏辉能源	47,492,508.82	21.13
8	002129	TCL 中环	47,430,051.58	21.10
9	002865	钧达股份	46,359,159.00	20.62
10	603688	石英股份	43,594,188.15	19.39
11	688680	海优新材	37,594,306.49	16.73
12	603185	上机数控	37,264,566.09	16.58
13	688559	海目星	36,574,001.08	16.27
14	002850	科达利	36,314,326.91	16.16
15	688032	禾迈股份	32,321,715.18	14.38
16	688186	广大特材	31,579,696.28	14.05
17	603658	安图生物	30,974,933.80	13.78
18	300861	美畅股份	30,081,567.08	13.38
19	300760	迈瑞医疗	29,249,899.50	13.01
20	002812	恩捷股份	28,802,144.79	12.81
21	003022	联泓新科	27,110,941.50	12.06
22	688388	嘉元科技	27,051,815.50	12.03
23	300035	中科电气	26,990,639.00	12.01
24	300529	健帆生物	26,382,091.89	11.74
25	605366	宏柏新材	26,376,556.90	11.73
26	300769	德方纳米	26,168,472.88	11.64
27	300569	天能重工	26,112,329.72	11.62
28	300207	欣旺达	26,003,443.93	11.57
29	601615	明阳智能	25,989,215.54	11.56
30	603806	福斯特	25,752,465.80	11.46
31	688348	昱能科技	25,622,850.95	11.40
32	688349	三一重能	25,481,474.34	11.34
33	300382	斯莱克	25,069,293.34	11.15
34	603659	璞泰来	24,892,937.00	11.07
35	000963	华东医药	24,572,235.63	10.93
36	300347	泰格医药	24,338,570.78	10.83
37	603063	禾望电气	23,379,368.31	10.40
38	002738	中矿资源	23,338,322.35	10.38
39	603026	胜华新材	23,160,337.94	10.30
40	300916	朗特智能	23,149,282.25	10.30
41	300260	新莱应材	23,030,838.08	10.25
42	688518	联赢激光	22,526,701.89	10.02

43	603822	嘉澳环保	21,941,985.54	9.76
44	600549	厦门钨业	21,421,172.00	9.53
45	300630	普利制药	20,859,378.20	9.28
46	688308	欧科亿	20,108,668.36	8.95
47	300759	康龙化成	19,459,210.00	8.66
48	300568	星源材质	19,309,345.26	8.59
49	601218	吉鑫科技	19,132,579.00	8.51
50	002466	天齐锂业	18,729,708.00	8.33
51	000661	长春高新	17,980,724.25	8.00
52	002262	恩华药业	17,700,134.00	7.87
53	002192	融捷股份	17,266,981.00	7.68
54	300450	先导智能	17,035,932.00	7.58
55	601865	福莱特	16,918,951.00	7.53
56	600732	爱旭股份	16,702,906.00	7.43
57	600566	济川药业	16,495,312.62	7.34
58	601958	金铂股份	16,289,885.70	7.25
59	300718	长盛轴承	16,075,224.25	7.15
60	688196	卓越新能	15,802,275.62	7.03
61	300068	南都电源	15,267,409.90	6.79
62	688700	东威科技	14,708,410.28	6.54
63	301327	华宝新能	14,641,749.54	6.51
64	603667	五洲新春	14,553,047.20	6.47
65	300482	万孚生物	14,423,337.63	6.42
66	688106	金宏气体	14,182,804.57	6.31
67	002006	精功科技	14,154,496.00	6.30
68	000657	中钨高新	14,105,171.00	6.28
69	000155	川能动力	13,964,999.60	6.21
70	300122	智飞生物	13,492,854.84	6.00
71	600522	中天科技	12,940,288.00	5.76
72	603938	三孚股份	12,778,160.16	5.68
73	301101	明月镜片	12,631,476.51	5.62
74	300707	威唐工业	12,154,341.80	5.41
75	688596	正帆科技	11,814,364.35	5.26
76	600995	南网储能	11,704,838.00	5.21
77	002057	中钢天源	11,477,380.08	5.11
78	603212	赛伍技术	11,221,675.52	4.99
79	300421	力星股份	11,219,872.30	4.99
80	601888	中国中免	11,173,428.00	4.97
81	300573	兴齐眼药	11,129,839.00	4.95
82	300073	当升科技	11,056,152.24	4.92
83	603392	万泰生物	10,981,622.46	4.89
84	688768	容知日新	10,885,724.83	4.84
85	300567	精测电子	10,708,448.00	4.76

86	002756	永兴材料	10,152,146.00	4.52
87	000301	东方盛虹	10,149,968.00	4.52
88	000546	金圆股份	9,894,138.00	4.40
89	300776	帝尔激光	9,552,661.00	4.25
90	688499	利元亨	9,401,044.25	4.18
91	300750	宁德时代	9,356,112.41	4.16
92	601128	常熟银行	9,220,532.00	4.10
93	002080	中材科技	8,655,872.00	3.85
94	600741	华域汽车	8,564,796.00	3.81
95	002434	万里扬	8,425,052.16	3.75
96	605305	中际联合	8,203,324.38	3.65
97	688778	厦钨新能	8,145,639.86	3.62
98	300463	迈克生物	7,886,722.95	3.51
99	688383	新益昌	7,844,408.70	3.49
100	688123	聚辰股份	7,805,668.20	3.47
101	300014	亿纬锂能	7,601,357.00	3.38
102	600110	诺德股份	7,470,031.00	3.32
103	002739	万达电影	7,086,425.53	3.15
104	300700	岱勒新材	7,074,530.75	3.15
105	688005	容百科技	7,042,528.31	3.13
106	301206	三元生物	6,927,355.28	3.08
107	688556	高测股份	6,770,173.27	3.01
108	688290	景业智能	6,575,835.21	2.93
109	002532	天山铝业	6,209,538.00	2.76
110	603982	泉峰汽车	6,185,243.00	2.75
111	002648	卫星化学	6,139,463.00	2.73
112	002807	江阴银行	6,094,217.00	2.71
113	002839	张家港行	6,019,630.00	2.68
114	300587	天铁股份	5,902,098.00	2.63
115	002669	康达新材	5,792,480.00	2.58
116	300443	金雷股份	5,776,533.00	2.57
117	603997	继峰股份	5,743,446.00	2.56
118	300129	泰胜风能	5,672,881.00	2.52
119	688155	先惠技术	5,545,006.46	2.47
120	688063	派能科技	5,498,999.44	2.45
121	300590	移为通信	5,399,085.00	2.40
122	301063	海锅股份	5,397,171.77	2.40
123	688299	长阳科技	5,082,754.56	2.26
124	300601	康泰生物	5,074,161.00	2.26
125	300457	赢合科技	4,904,156.00	2.18
126	603799	华友钴业	4,829,620.00	2.15
127	603348	文灿股份	4,728,823.00	2.10
128	300725	药石科技	4,698,008.00	2.09

129	300969	恒帅股份	4,664,531.00	2.08
130	002824	和胜股份	4,567,190.00	2.03

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。

8.4.3 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	5,883,643,668.00
卖出股票收入（成交）总额	2,782,437,981.71

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。

8.5 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	163,556,636.89	5.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	163,556,636.89	5.30

8.6 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	019656	21 国债 08	538,000	54,742,192.77	1.77
2	019674	22 国债 09	413,000	41,830,325.94	1.36
3	019666	22 国债 01	347,300	35,431,879.03	1.15
4	019663	21 国债 15	252,000	25,410,416.55	0.82
5	019679	22 国债 14	61,000	6,141,822.60	0.20

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,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,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指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股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

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

8.12.2 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。

8.12.3 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	818,955.75
2	应收清算款	209,808.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,708,112.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,736,876.82

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
南方潜力新蓝筹混合 A	69,892	10,670.26	448,804,102.84	60.18%	296,961,525.25	39.82%
南方潜力新蓝筹混合 C	73,052	10,424.56	667,910,158.28	87.71%	93,625,091.22	12.29%
合计	142,944	10,544.69	1,116,714,261.12	74.09%	390,586,616.47	25.91%

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。

9.2 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	南方潜力新蓝筹混合 A	2,231,694.32	0.2992%
	南方潜力新蓝筹混合 C	69,104.51	0.0091%
	合计	2,300,798.83	0.1526%

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）。

9.3 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	南方潜力新蓝筹混合 A	50~100
	南方潜力新蓝筹混合 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	南方潜力新蓝筹混合 A	0
	南方潜力新蓝筹混合 C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产份额总量的数量区间（万份）
钟贇	公募基金	50~100
	私募资产管理计划	0
	合计	50~100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方潜力新蓝筹混合 A	南方潜力新蓝筹混合 C
基金合同生效日(2018年6月5日)基金份额总额	347,241,053.07	-
本报告期期初基金份额总额	83,150,268.11	-
本报告期基金总申购份额	1,059,055,029.19	1,222,936,078.26
减：报告期基金总赎回份额	396,439,669.21	461,400,828.76
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	745,765,628.09	761,535,249.50

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 5 年，本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 90,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 1 月 29 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	个别基金内部控制不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人已及时按要求改正并报告
其他	/

11.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	2	1,578,150,835.91	18.26%	1,453,936.94	18.29%	-
国泰君安	1	812,950,442.29	9.40%	748,682.72	9.42%	-
兴业证券	1	771,834,772.11	8.93%	709,141.33	8.92%	-
光大证券	1	742,780,778.53	8.59%	682,633.42	8.59%	-
长江证券	1	705,002,386.36	8.16%	649,518.30	8.17%	-
方正证券	1	587,949,213.89	6.80%	539,414.06	6.78%	-
中信证券	2	528,036,496.40	6.11%	485,108.34	6.10%	-
中金公司	1	514,962,214.74	5.96%	473,214.27	5.95%	-
安信证券	1	408,588,805.67	4.73%	376,013.94	4.73%	-
长城证券	1	383,319,205.78	4.43%	353,154.36	4.44%	-
招商证券	1	375,901,416.37	4.35%	346,098.65	4.35%	-
国盛证券	1	251,191,040.20	2.91%	231,418.97	2.91%	-
银河证券	1	230,182,370.32	2.66%	210,797.50	2.65%	-
西部证券	1	216,986,790.86	2.51%	197,957.38	2.49%	-
国金证券	1	155,621,456.93	1.80%	143,370.44	1.80%	-
中山证券	1	151,622,262.19	1.75%	139,684.78	1.76%	-
华安证券	1	116,115,414.44	1.34%	106,979.08	1.35%	-
第一创业	1	63,625,145.27	0.74%	58,617.38	0.74%	-
宏信证券	1	50,154,119.35	0.58%	45,706.16	0.57%	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
诚浩证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	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：

华安证券

退租交易单元：

无

11.7.2 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	107,375,694.06	32.75%	10,000,000.00	7.42%	-	-
国泰君安	7,167,443.47	2.19%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	581,616.06	0.18%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	92,076,197.50	28.09%	44,000,000.00	32.63%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
安信证券	28,581,017.60	8.72%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	12,871,312.00	3.93%	19,344,000.00	14.35%	-	-
银河证券	12,919,874.70	3.94%	-	-	-	-

西部证券	12,874,553.10	3.93%	61,500,000.00	45.61%	-	-
国金证券	19,417,403.00	5.92%	-	-	-	-
中山证券	11,930,005.70	3.64%	-	-	-	-
华安证券	22,035,624.00	6.72%	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
诚浩证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
3	关于南方潜力新蓝筹混合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	2022-01-06
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金获配川能动力（000155）非公开发行 A 股的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-17
5	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金申购费率优惠标准的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-18
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-12
7	南方基金关于旗下部分基金增加长沙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	2022-03-02

8	南方基金关于旗下部分基金增加北京农商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	2022-03-07
9	南方基金关于旗下部分基金增加中银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	2022-03-08
10	南方基金关于旗下部分基金增加安信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	2022-03-14
11	关于南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修订相关法律文件的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-15
12	南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金 C 类基金份额开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-15
13	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-26
14	南方基金关于旗下部分基金增加西南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	2022-03-30
15	南方基金关于旗下部分基金增加国泰君安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	2022-04-06
16	南方基金关于旗下部分基金增加华泰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	2022-04-07
17	南方基金关于旗下部分基金增加国信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	2022-04-07
18	南方基金关于旗下部分基金增加海通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	2022-04-11
19	南方基金关于旗下部分基金增加坤元基金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	2022-04-12
20	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-16
21	南方基金关于旗下部分基金增加华宝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	2022-04-19
22	南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金限制大额申购、定投和转换转入业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会	2022-04-20

		基金电子披露网站	
23	南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金分红公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
24	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	2022-04-22
25	南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金恢复大额申购、定投和转换转入业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-26
26	南方基金关于旗下部分基金增加日照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	2022-05-16
27	南方基金关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构及开通相关业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-24
28	南方基金管理股份有限公司关于调整旗下基金大额申购等业务安排的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-27
29	南方基金管理股份有限公司关于董事长变更的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-28
30	南方基金关于旗下部分基金增加中航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	2022-05-30
31	南方基金关于旗下部分基金增加四川天府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	2022-06-02
32	南方基金关于旗下部分基金增加深圳农商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	2022-06-23
33	南方基金关于旗下部分基金增加中欧财富为销售机构及开通相关业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-27
34	南方基金关于旗下部分基金增加通华财富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	2022-06-27
35	南方基金关于旗下部分基金增加光大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	2022-07-12
36	南方基金关于旗下部分基金增加普益基金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	2022-07-12
37	南方基金管理股份有限公司关于修订公司旗下	证券日报、基金管理	2022-07-15

	部分公开募集证券投资基金托管协议有关条款的公告	人网站、中国证监会基金电子披露网站	
38	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-16
39	关于注意防范冒用南方基金及子公司、南方基金投研人员名义从事诈骗活动的风险提示	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-20
40	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-27
41	南方基金关于旗下部分基金增加东方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	2022-08-05
42	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金增加侧袋机制并相应修订基金合同有关条款的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-08-17
43	南方基金关于旗下部分基金增加山西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	2022-08-22
44	南方基金关于旗下部分基金增加中信建投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	2022-08-30
45	南方基金关于旗下部分基金增加泰信财富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	2022-08-31
46	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-09
47	南方基金关于旗下部分基金增加中信期货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	2022-09-15
48	南方基金关于旗下部分基金增加中信证券（山东）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	2022-09-15
49	南方基金关于旗下部分基金增加中信证券华南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	2022-09-15
50	南方基金关于旗下部分基金增加中信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	2022-09-15
51	南方基金关于旗下部分基金增加招商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	2022-09-20

52	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-29
53	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-30
54	南方基金关于旗下部分基金增加中信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	2022-10-19
55	南方基金关于旗下部分基金增加厦门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	2022-10-25
56	南方基金关于旗下部分基金增加粤开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	2022-10-25
57	南方基金关于旗下部分基金增加中国人寿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	2022-10-28
58	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-02
59	南方基金关于旗下部分基金增加平安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	2022-11-04
60	南方基金关于旗下部分基金增加首创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	2022-11-08
61	南方基金关于旗下部分基金增加万联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	2022-11-09
62	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-11
63	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	2022-11-16
64	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-16
65	南方基金关于旗下部分基金增加国金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	2022-11-25
66	南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金限制大额申购、定投和转换转入业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会	2022-12-02

		基金电子披露网站	
67	南方基金关于旗下部分基金增加广发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	2022-12-03
68	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-03
69	南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金分红公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-03
70	南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金恢复大额申购、定投和转换转入业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-07
71	南方基金关于旗下部分基金增加蒙商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	2022-12-10
72	南方基金关于旗下部分基金增加东方财富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	2022-12-15
73	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行基金费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-15
74	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-16
75	关于注意防范冒用南方基金及子公司、南方基金投研人员名义从事诈骗活动的风险提示	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-16
76	南方基金关于旗下部分基金增加中金财富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	2022-12-23
77	南方基金关于旗下部分基金增加博时财富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	2022-12-27

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过 20% 的时间区间					
机构	1	20220705-20220717; 20220512-20220519	-	196,186,516.87	-	196,186,516.87	13.02%

产品特有风险

本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录**13.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会批准设立南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方潜力新蓝筹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、《南方潜力新蓝筹混合型证券投资基金 2022 年年度报告》原文。

13.2 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。

13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>