

# 南方价值臻选混合型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

## 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方价值臻选混合型证券投资基金	
基金简称	南方价值臻选混合	
基金主代码	012426	
交易代码	012426	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 21 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	387,645,738.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C
下属分级基金的交易代码	012426	012427
报告期末下属分级基金的份 额总额	352,686,188.87 份	34,959,549.40 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金依托于基金管理人的投资研究平台，紧密跟踪中国经济转型的发展方向，精选质地优秀、具备长期价值增长潜力的公司。股票投资采用定量和定性分析相结合的策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<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、南方价值臻选混合 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-29,777,659.83
本期利润	9,501,271.07
加权平均基金份额本期利润	0.0261
本期加权平均净值利润率	3.03%
本期基金份额净值增长率	3.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-43,832,557.53
期末可供分配基金份额利润	-0.1243
期末基金资产净值	308,853,631.34
期末基金份额净值	0.8757
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	-12.43%
-------------	---------

## 2、南方价值臻选混合 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,652,978.39
本期利润	92,977.12
加权平均基金份额本期利润	0.0037
本期加权平均净值利润率	0.43%
本期基金份额净值增长率	2.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-4,892,523.06
期末可供分配基金份额利润	-0.1399
期末基金资产净值	30,067,026.34
期末基金份额净值	0.8601
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-13.99%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

## 南方价值臻选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.17%	0.55%	-1.17%	0.24%	-1.00%	0.31%
过去三个月	1.54%	0.70%	1.14%	0.37%	0.40%	0.33%
过去六个月	3.11%	0.83%	3.11%	0.44%	0.00%	0.39%
过去一年	-4.46%	0.73%	-1.74%	0.43%	-2.72%	0.30%
过去三年	-12.42%	0.78%	-11.60%	0.53%	-0.82%	0.25%
自基金合同生效起至今	-12.43%	0.78%	-10.54%	0.53%	-1.89%	0.25%

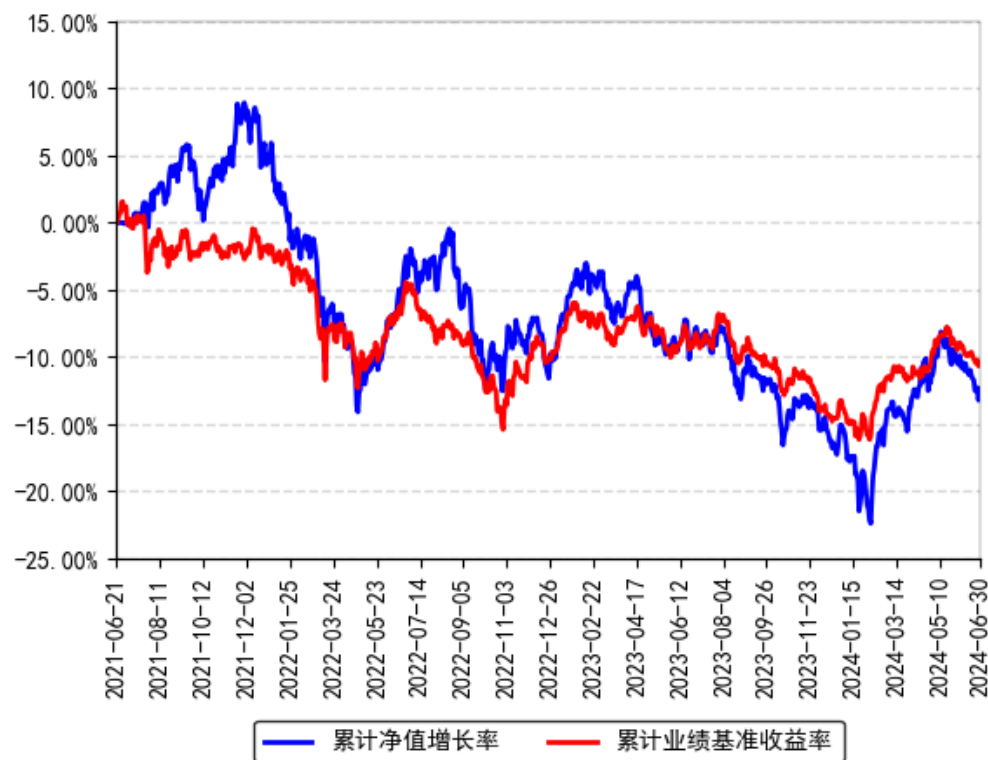
## 南方价值臻选混合 C

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	-2.21%	0.55%	-1.17%	0.24%	-1.04%	0.31%
过去三个月	1.40%	0.70%	1.14%	0.37%	0.26%	0.33%
过去六个月	2.82%	0.83%	3.11%	0.44%	-0.29%	0.39%
过去一年	-5.01%	0.73%	-1.74%	0.43%	-3.27%	0.30%
过去三年	-13.96%	0.78%	-11.60%	0.53%	-2.36%	0.25%
自基金合同生效起至今	-13.99%	0.78%	-10.54%	0.53%	-3.45%	0.25%

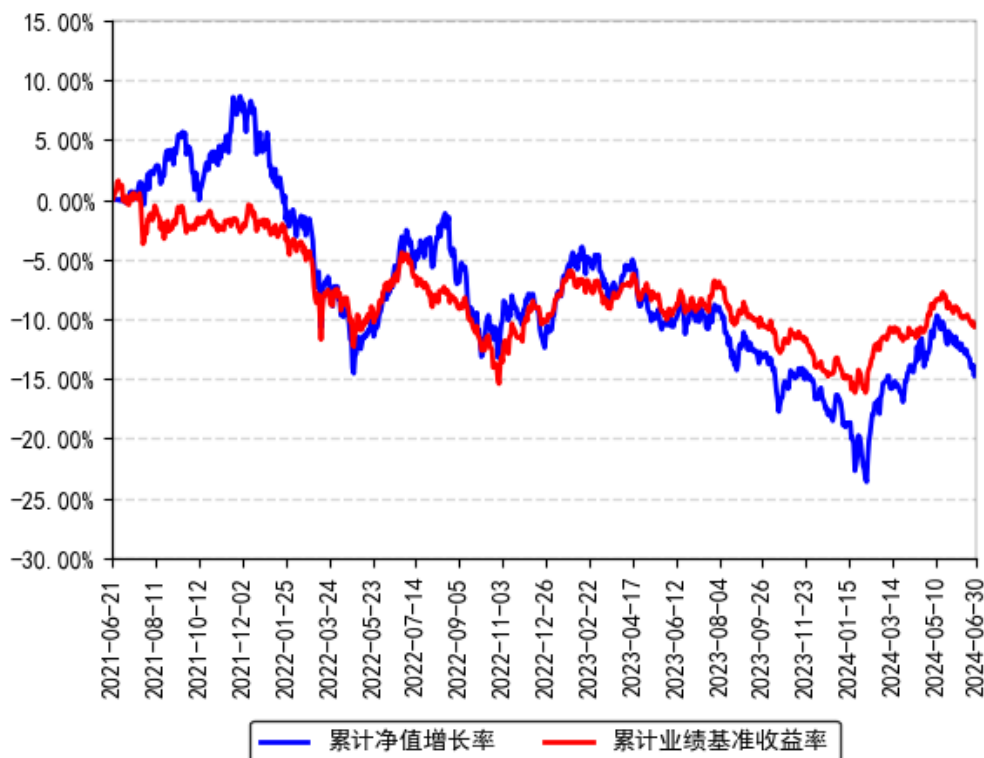
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方价值臻选混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





南方价值臻选混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 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。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。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

#### 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	说明

		任职日期	离任日期	年限	
卢玉珊	本基金基金经理	2021 年 6 月 21 日	-	15 年	女，清华大学会计学硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金，历任研究部研究员、高级研究员，负责纺织服装、商贸零售的行业研究工作；2015 年 2 月 26 日至 2015 年 12 月 30 日，任南方成份、南方安心的基金经理助理；2015 年 5 月 19 日至 2015 年 12 月 30 日，任南方改革机遇的基金经理助理；2015 年 12 月 30 日至 2019 年 1 月 9 日，任南方安心基金经理；2019 年 1 月 9 日至今，任南方核心竞争混合基金经理；2019 年 1 月 25 日至今，任南方改革机遇基金经理；2020 年 5 月 15 日至今，任南方君选基金经理；2021 年 6 月 21 日至今，任南方价值臻选混合基金经理；2022 年 2 月 7 日至今，任南方比较优势混合基金经理；2022 年 9 月 14 日至今，任南方鑫悦 15 个月持有混合基金经理；2022 年 11 月 15 日至今，任南方君誉混合基金经理；2024 年 5 月 24 日至今，兼任投资经理。

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
卢玉珊	公募基金	7	1,970,902,693.12	2015 年 12 月 30 日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	10	10,838,490,115.51	2022 年 12 月 01 日
	合计	17	12,809,392,808.63	-

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运

作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为69次，是由于指数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

上半年整体市场维持震荡，一季度大幅波动，在1月下跌后强势反弹，二季度在宏观弱复苏背景下震荡下跌。具体来看，沪深300上涨0.89%，上证指数、深证成指和创业板指分别下跌0.25%、7.10%和10.99%，中证1000和国证2000分别下跌16.84%和19.67%。分行业看，银行、煤炭和公用事业涨幅都在10%以上，家用电器、石油石化、通信、交运和有色也是正收益，计算机、商贸零售、社会服务、传媒、地产等行业有20%以上的跌幅。整体来看低估值、大盘风格占优，成长、小盘表现较弱。

我们年初看好的高股息、出口链、上游资源品方向上基本是正确的，但是由于结构上偏均衡和分散，尾部持仓形成了一定的拖累，没有显著跑赢市场。中长期看，经济高质量发展背景下，投资范式向更看重确定性和可持续性等方向的转变很可能是长期趋势，叠加监管政策导向明确，小盘的估值溢价大概率将继续收敛。我们继续减持尾部的中小市值个股，提高组合集中度。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 0.8757 元，报告期内，份额净值增长率为 3.11%，同期业绩基准增长率为 3.11%；本基金 C 份额净值为 0.8601 元，报告期内，份额净值增长率为 2.82%，同期业绩基准增长率为 3.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场整体估值无论是相对自身历史，还是相对债券资产，均处于相对低估状态，以年度为展望，权益类资产仍是性价比较高的选择。对于标的的选择上，我们会更加看重竞争格局的稳定、资产负债表的稳健和自由现金流的健康。

自 2022 年以来，我们可以观察到上市公司的分红比例正在逐步提升，这不仅支撑了股息率，也反映出对股东回报的日益重视。在这种长期投资视角下，投资者的估值体系正在悄然发生变化，逐渐从传统的市盈率（PE）和市净率（PB）转向更加关注股息率以及企业价值与自由现金流的比率（EV/FCF）。

这种转变意味着投资者开始更加注重公司能够提供的实际回报，而不仅仅是依赖市场估值的提升。高分红比例和股息率的提升，为投资者提供了更稳定的现金流入，这对于寻求长期稳定收益的投资者来说尤为重要。同时，EV/FCF 提供了一个更为全面的视角来评估公司的内在价值。它不仅考虑了公司的盈利能力，还考虑了公司的现金流创造能力，这有助于投资者识别那些具有强大自我融资能力、较低财务风险和良好长期增长潜力的企业。

展望后市，我们主要关注以下几条投资主线：一是现金流较好的低估值高股息的个股，包括运营商、能源、水电、高速公路等在内；二是出口链上具有国际竞争力的企业，比如家电、电力设备、纺织制造等；三是供需结构较好的上游资源品；四是美股科技映射。同时我们将增加对底部赔率品种的研究。

#### 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内,本基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

### § 6 中期财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：南方价值臻选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	18,336,963.37	21,021,993.43
结算备付金		58,473.23	116,037.50
存出保证金		22,132.64	37,036.80
交易性金融资产	6.4.3.2	249,357,956.78	276,861,337.09
其中：股票投资		247,737,473.13	263,604,413.55
基金投资		-	-
债券投资		1,620,483.65	13,256,923.54
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	-	-4,363.36
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		76,944,395.11	38,820,840.85
应收股利		288,469.16	-
应收申购款		30,599.59	3,117.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		345,038,989.88	336,855,999.36
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		150,336.82	1,810,207.74
应付赎回款		5,377,829.42	305,170.91
应付管理人报酬		340,923.23	341,531.97
应付托管费		56,820.55	56,922.00
应付销售服务费		15,600.76	8,600.27
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13.32	17.22
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	176,808.10	133,059.49
负债合计		6,118,332.20	2,655,509.60
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	387,645,738.27	393,800,896.12
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	-48,725,080.59	-59,600,406.36
净资产合计		338,920,657.68	334,200,489.76
负债和净资产总计		345,038,989.88	336,855,999.36

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，南方价值臻选混合 A 份额净值 0.8757 元，基金份额总额 352,686,188.87 份；南方价值臻选混合 C 份额净值 0.8601 元，基金份额总额 34,959,549.40 份；总份额合计 387,645,738.27 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方价值臻选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		12,080,255.61	11,931,347.60
1.利息收入		142,483.27	155,320.12
其中：存款利息收入	6.4.3.9	118,665.22	130,776.62
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		23,818.05	24,543.50
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-29,089,086.80	-826,146.64
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-33,877,145.81	-4,036,217.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	103,056.53	142,030.70
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	4,685,002.48	3,068,040.61
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	41,024,886.41	12,582,427.28
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	1,972.73	19,746.84
减：二、营业总支出		2,486,007.42	3,706,150.41
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	1,995,153.23	3,044,749.88
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.6.2.2	332,525.54	507,458.34
3.销售服务费	6.4.6.2.3	63,907.35	59,509.81
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		9.31	5.48
8.其他费用	6.4.3.16	94,411.99	94,426.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,594,248.19	8,225,197.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,594,248.19	8,225,197.19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,594,248.19	8,225,197.19

### 6.3 净资产变动表

会计主体：南方价值臻选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	393,800,896.12	-	-59,600,406.36	334,200,489.76
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-



二、本期期初净资产	393,800,896.12	-	-59,600,406.36	334,200,489.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,155,157.85	-	10,875,325.77	4,720,167.92
（一）、综合收益总额	-	-	9,594,248.19	9,594,248.19
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-6,155,157.85	-	1,281,077.58	-4,874,080.27
其中：1.基金申购款	27,298,407.87	-	-3,513,344.95	23,785,062.92
2.基金赎回款	-33,453,565.72	-	4,794,422.53	-28,659,143.19
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	387,645,738.27	-	-48,725,080.59	338,920,657.68
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	449,664,720.98	-	-45,422,028.46	404,242,692.52
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	449,664,720.98	-	-45,422,028.46	404,242,692.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-28,352,105.91	-	10,043,747.86	-18,308,358.05
（一）、综合收益总额	-	-	8,225,197.19	8,225,197.19
（二）、本期基金	-28,352,105.91	-	1,818,550.67	-26,533,555.24

份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	8,804,724.98	-	-580,343.99	8,224,380.99
2.基金赎回款	-37,156,830.89	-	2,398,894.66	-34,757,936.23
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	421,312,615.07	-	-35,378,280.60	385,934,334.47

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\_\_\_\_                      \_\_\_\_常克川\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_  
基金管理人负责人              主管会计工作负责人              会计机构负责人

## 6.4 报表附注

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

本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。

### 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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

#### 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	18,336,963.37
等于：本金	18,330,069.36
加：应计利息	6,894.01
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	18,336,963.37

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	242,314,972.19	-	247,737,473.13	5,422,500.94
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3,679.35	1,620,483.65	265,804.30
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,679.35	1,620,483.65	265,804.30
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	243,665,972.19	3,679.35	249,357,956.78	5,688,305.24

#### 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

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

#### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.3.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	92,272.74
其中：交易所市场	92,272.74
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	176,808.10

#### 6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方价值臻选混合 A		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	373,731,393.55	373,731,393.55
本期申购	1,540,591.59	1,540,591.59
本期赎回（以“-”号填列）	-22,585,796.27	-22,585,796.27
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	352,686,188.87	352,686,188.87

南方价值臻选混合 C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,069,502.57	20,069,502.57
本期申购	25,757,816.28	25,757,816.28
本期赎回（以“-”号填列）	-10,867,769.45	-10,867,769.45
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	34,959,549.40	34,959,549.40

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

南方价值臻选混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,762,675.00	-40,556,422.25	-56,319,097.25
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-15,762,675.00	-40,556,422.25	-56,319,097.25
本期利润	-29,777,659.83	39,278,930.90	9,501,271.07
本期基金份额交易产生的变动数	2,288,374.46	696,894.19	2,985,268.65
其中：基金申购款	-121,635.29	-120,927.85	-242,563.14
基金赎回款	2,410,009.75	817,822.04	3,227,831.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-43,251,960.37	-580,597.16	-43,832,557.53

南方价值臻选混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,118,828.00	-2,162,481.11	-3,281,309.11
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,118,828.00	-2,162,481.11	-3,281,309.11
本期利润	-1,652,978.39	1,745,955.51	92,977.12
本期基金份额交易产生的变动数	-2,032,253.29	328,062.22	-1,704,191.07
其中：基金申购款	-3,460,019.67	189,237.86	-3,270,781.81
基金赎回款	1,427,766.38	138,824.36	1,566,590.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,804,059.68	-88,463.38	-4,892,523.06

#### 6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	116,259.60
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	2,194.25
其他	211.37
合计	118,665.22

### 6.4.3.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	159,126,386.86
减：卖出股票成本总额	192,662,811.73
减：交易费用	340,720.94
买卖股票差价收入	-33,877,145.81

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	73,709.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	29,347.03
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	103,056.53

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,718,189.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,462,470.00
减：应计利息总额	226,364.16
减：交易费用	8.12
买卖债券差价收入	29,347.03

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

#### 6.4.3.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

#### 6.4.3.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,685,002.48
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	4,685,002.48

### 6.4.3.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	41,024,886.41
——股票投资	41,045,149.55
——债券投资	-20,263.14
——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	41,024,886.41

### 6.4.3.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,961.59
基金转换费收入	11.14
合计	1,972.73

### 6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	436.00
其他	440.63
合计	94,411.99

#### 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

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	5,353,493.62	1.82%	75,913,844.08	17.44%

###### 6.4.6.1.2 债券交易



金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	-	-	140,227.73	1.61%

#### 6.4.6.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	3,979.41	1.78%	3,727.88	4.04%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	69,344.71	17.40%	40,090.55	16.83%

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符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告（2024）3 号）相关规定。《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》生效后，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,995,153.23	3,044,749.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	837,796.63	1,276,105.11
应支付基金管理人的净管理费	1,157,356.60	1,768,644.77

注：于 2023 年 7 月 10 日前，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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% ÷ 当年天数。

根据《南方基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，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 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% \div \text{当年天数}。$$

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	332,525.54	507,458.34

注：于 2023 年 7 月 10 日前，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

根据《南方基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}。$$

#### 6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C	合计
工商银行	-	15,098.75	15,098.75
华泰证券	-	498.75	498.75
南方基金	-	7,747.70	7,747.70
兴业证券	-	3,922.41	3,922.41
合计	-	27,267.61	27,267.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C	合计
工商银行	-	20,207.62	20,207.62
华泰证券	-	667.68	667.68

南方基金	-	9,749.73	9,749.73
兴业证券	-	77.04	77.04
合计	-	30,702.07	30,702.07

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

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

#### 6.4.6.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	18,336,963.37	116,259.60	82,171,092.29	126,071.58

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日				
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

				数量（单位： 股/张）	总金额
华泰联合	688709	成都华微	网下申购	6,303	98,894.07
华泰联合	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88
华泰联合	603341	龙旗科技	网下申购	1,699	44,174.00
华泰联合	603312	西典新能	网下申购	1,192	34,591.84
兴业证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
华泰联合	688472	阿特斯	网下申购	16,207	179,897.70
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	6,596	137,988.32
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	118031	天 23 转债	配债	270	27,000.00
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券	301322	绿通科技	网下申购	1,302	170,705.22
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	2,253	72,749.37
兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	网下申购	47,332	269,319.08

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 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（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301589	诺瓦星云	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期	126.89	188.01	335	42,508.15	62,983.35	-
301589	诺瓦星云	2024	1-6 个	锁定期	-	188.0	268	-	50,386.68	-

		年 5 月 30 日	月(含)	转增		1				
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	86.96	174.9 3	123	10,696.08	21,516.39	-
301536	星宸科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024 年 5 月 22 日	1-6 个 月(含)	锁定期 转增	-	91.24	43	-	3,923.32	-
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	15.69	18.79	631	9,900.39	11,856.49	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股锁 定期	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	22.66	15.89	492	11,148.72	7,817.88	-

301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股锁定期	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定期	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股锁定期	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股锁定期	26.00	37.49	170	4,420.00	6,373.30	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定期	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股锁定期	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股锁定期	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股锁定期	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股锁定期	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股锁定期	23.35	25.13	145	3,385.75	3,643.85	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股锁定期	72.46	68.06	51	3,695.46	3,471.06	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股锁定期	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定期	29.02	25.36	120	3,482.40	3,043.20	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股锁定期	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024年1月	6个月	新股锁定期	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-

		17 日								
001387	雪祺电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定期	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024 年 6 月 3 日	1-6 个月(含)	锁定期转增	-	15.25	40	-	610.00	-

## 6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

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

注：本基金持有的上述流通受限证券，根据中国证监会、证券交易所发布的相关规定，在受限期内不得转让：

1. 根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2. 基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3. 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。

4. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

## 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

## 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

## 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.9 金融工具风险及管理

### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

### 6.4.9.2 信用风险

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人



的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

### 6.4.9.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，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超过基金资产净值的 15%。于本报告期末，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符合该要求。

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。于本报告期末，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。

#### 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。

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。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。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	18,336,963.37	-	-	-	18,336,963.37
结算备付金	58,473.23	-	-	-	58,473.23
存出保证金	22,132.64	-	-	-	22,132.64
交易性金融资产	346,505.49	1,242,676.24	31,301.92	247,737,473.13	249,357,956.78
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	-	-	-	76,944,395.11	76,944,395.11
应收股利	-	-	-	288,469.16	288,469.16
应收申购款	15.00	-	-	30,584.59	30,599.59
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	18,764,089.73	1,242,676.24	31,301.92	325,000,921.99	345,038,989.88
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	-	-	-	150,336.82	150,336.82
应付赎回款	-	-	-	5,377,829.42	5,377,829.42
应付管理人报酬	-	-	-	340,923.23	340,923.23
应付托管费	-	-	-	56,820.55	56,820.55
应付销售服务费	-	-	-	15,600.76	15,600.76
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	13.32	13.32
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	176,808.10	176,808.10
负债总计	-	-	-	6,118,332.20	6,118,332.20
利率敏感度缺口	18,764,089.73	1,242,676.24	31,301.92	318,882,589.79	338,920,657.68
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	21,021,993.43	-	-	-	21,021,993.43
结算备付金	116,037.50	-	-	-	116,037.50
存出保证金	37,036.80	-	-	-	37,036.80
交易性金融资产	11,156,169.86	1,716,468.48	384,285.20	263,604,413.55	276,861,337.09
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-4,363.36	-	-	-	-4,363.36
债权投资	-	-	-	-	-

其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	38,820,840.85	38,820,840.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	20.00	-	-	3,097.05	3,117.05
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	32,326,894.23	1,716,468.48	384,285.20	302,428,351.45	336,855,999.36
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1,810,207.74	1,810,207.74
应付赎回款	-	-	-	305,170.91	305,170.91
应付管理人报酬	-	-	-	341,531.97	341,531.97
应付托管费	-	-	-	56,922.00	56,922.00
应付销售服务费	-	-	-	8,600.27	8,600.27
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	17.22	17.22
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	133,059.49	133,059.49
负债总计	-	-	-	2,655,509.60	2,655,509.60
利率敏感度缺口	32,326,894.23	1,716,468.48	384,285.20	299,772,841.85	334,200,489.76

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	0.00	-345.26
	2.市场利率平行下降 25 个基点	0.00	359.41

#### 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或负债，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 2024 年 6 月 30 日					合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	14,632,315.75	-	-	-	14,632,315.75
资产合计	-	14,632,315.75	-	-	-	14,632,315.75
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	-	14,632,315.75	-	-	-	14,632,315.75

项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日					合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	8,805,924.61	-	-	-	8,805,924.61
资产合计	-	8,805,924.61	-	-	-	8,805,924.61
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	-	8,805,924.61	-	-	-	8,805,924.61

险敞口净额						
-------	--	--	--	--	--	--

#### 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	731,615.79	440,296.23
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-731,615.79	-440,296.23

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：本基金股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例范围为 30%-80%（其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%）。本基金每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	247,737,473.13	73.10	263,604,413.55	78.88
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	247,737,473.13	73.10	263,604,413.55	78.88

#### 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 上升 5%	9,470,011.10	10,976,398.29
2. 沪深 300 下降 5%	-9,470,011.10	-10,976,398.29	

#### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	248,989,248.88
第二层次	45,611.11
第三层次	323,096.79
合计	249,357,956.78

###### 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，确定相关金融工具的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

于本报告期末, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

### 6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

### 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	247,737,473.13	71.80
	其中: 股票	247,737,473.13	71.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,620,483.65	0.47
	其中: 债券	1,620,483.65	0.47
	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	18,395,436.60	5.33
8	其他各项资产	77,285,596.50	22.40
9	合计	345,038,989.88	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 1,688,463.47 元, 占基金资产净值比例 0.50%; 通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 12,943,852.28 元, 占基金资产净值比例 3.82%。

### 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	883,136.00	0.26
B	采矿业	34,749,771.50	10.25
C	制造业	141,046,686.59	41.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,818,816.51	7.62
E	建筑业	1,849,360.00	0.55
F	批发和零售业	1,785,379.52	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	11,780,327.96	3.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,795,108.30	1.41
J	金融业	4,410,567.00	1.30
K	房地产业	357,714.00	0.11
L	租赁和商务服务业	1,134,710.00	0.33
M	科学研究和技术服务业	612,360.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	3,331,782.00	0.98
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	282,000.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	267,438.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	233,105,157.38	68.78

### 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	2,028,632.09	0.60
材料	3,837,751.86	1.13
工业	2,234,477.94	0.66
非必需消费品	526,087.00	0.16
必需消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	854,487.53	0.25
科技	1,320,903.51	0.39
通讯	2,160,830.13	0.64
公用事业	1,170,457.34	0.35
房地产	498,688.35	0.15
政府	-	-
合计	14,632,315.75	4.32

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

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	000333	美的集团	97,700	6,301,650.00	1.86
2	600900	长江电力	196,000	5,668,320.00	1.67
3	600519	贵州茅台	3,800	5,576,082.00	1.65
4	600886	国投电力	267,000	4,870,080.00	1.44
5	601857	中国石油	458,000	4,726,560.00	1.39
6	601088	中国神华	69,500	3,083,715.00	0.91
7	01088	中国神华	45,000	1,476,488.07	0.44
8	601225	陕西煤业	171,100	4,409,247.00	1.30
9	601985	中国核电	376,700	4,015,622.00	1.18
10	000521	长虹美菱	461,800	3,500,444.00	1.03
11	000338	潍柴动力	209,800	3,407,152.00	1.01
12	603871	嘉友国际	190,870	3,376,490.30	1.00
13	300750	宁德时代	18,360	3,305,350.80	0.98
14	001965	招商公路	258,131	3,061,433.66	0.90
15	002028	思源电气	44,500	2,977,050.00	0.88
16	601567	三星医疗	79,100	2,768,500.00	0.82
17	601899	紫金矿业	155,200	2,726,864.00	0.80
18	000651	格力电器	66,200	2,596,364.00	0.77
19	600985	淮北矿业	152,400	2,551,176.00	0.75
20	600690	海尔智家	86,100	2,443,518.00	0.72
21	600285	羚锐制药	97,700	2,365,317.00	0.70
22	601077	渝农商行	359,000	1,802,180.00	0.53
23	03618	重庆农村商业银行	108,000	377,520.96	0.11
24	603993	洛阳钼业	244,800	2,080,800.00	0.61
25	600323	瀚蓝环境	99,300	2,075,370.00	0.61
26	002318	久立特材	83,700	1,952,721.00	0.58
27	601699	潞安环能	107,600	1,950,788.00	0.58
28	002938	鹏鼎控股	48,600	1,932,336.00	0.57
29	00883	中国海洋石油	92,000	1,880,850.94	0.55
30	601600	中国铝业	203,610	1,553,544.30	0.46
31	02600	中国铝业	60,000	291,875.06	0.09
32	002984	森麒麟	74,340	1,790,850.60	0.53
33	600398	海澜之家	191,700	1,771,308.00	0.52
34	600150	中国船舶	42,400	1,726,104.00	0.51
35	300979	华利集团	26,800	1,630,780.00	0.48
36	600585	海螺水泥	68,500	1,615,915.00	0.48
37	600027	华电国际	227,300	1,577,462.00	0.47
38	301004	嘉益股份	17,300	1,574,300.00	0.46
39	601966	玲珑轮胎	84,100	1,544,917.00	0.46

40	600188	兖矿能源	54,050	1,228,556.50	0.36
41	01171	兖矿能源	28,600	291,305.55	0.09
42	002142	宁波银行	68,410	1,509,124.60	0.45
43	600011	华能国际	113,700	1,093,794.00	0.32
44	00902	华能国际电 力股份	76,000	401,615.71	0.12
45	002475	立讯精密	37,200	1,462,332.00	0.43
46	601702	华峰铝业	79,400	1,449,844.00	0.43
47	688169	石头科技	3,623	1,422,389.80	0.42
48	000975	山金国际	87,100	1,418,859.00	0.42
49	002039	黔源电力	80,500	1,416,800.00	0.42
50	000999	华润三九	33,020	1,405,991.60	0.41
51	000726	鲁泰 A	211,900	1,402,778.00	0.41
52	601918	新集能源	142,300	1,387,425.00	0.41
53	605090	九丰能源	47,500	1,377,500.00	0.41
54	002311	海大集团	28,800	1,355,040.00	0.40
55	600741	华域汽车	82,000	1,343,160.00	0.40
56	002126	银轮股份	76,700	1,335,347.00	0.39
57	00941	中国移动	10,500	737,901.78	0.22
58	600941	中国移动	5,500	591,250.00	0.17
59	600566	济川药业	41,700	1,322,307.00	0.39
60	01070	TCL 电子	229,000	1,320,903.51	0.39
61	000425	徐工机械	183,500	1,312,025.00	0.39
62	600873	梅花生物	130,900	1,311,618.00	0.39
63	002737	葵花药业	53,700	1,255,506.00	0.37
64	601000	唐山港	263,600	1,238,920.00	0.37
65	002073	软控股份	166,500	1,230,435.00	0.36
66	600685	中船防务	43,400	1,210,860.00	0.36
67	689009	九号公司	32,052	1,179,834.12	0.35
68	600971	恒源煤电	98,600	1,177,284.00	0.35
69	300408	三环集团	39,514	1,153,413.66	0.34
70	600803	新奥股份	55,400	1,152,320.00	0.34
71	002327	富安娜	112,100	1,126,605.00	0.33
72	000429	粤高速 A	108,000	1,124,280.00	0.33
73	603239	浙江仙通	81,800	1,121,478.00	0.33
74	600176	中国巨石	99,043	1,094,425.15	0.32
75	600497	驰宏锌锗	200,700	1,071,738.00	0.32
76	600487	亨通光电	67,900	1,070,783.00	0.32
77	000589	贵州轮胎	211,000	1,069,770.00	0.32
78	600482	中国动力	54,300	1,057,764.00	0.31
79	000921	海信家电	32,300	1,041,352.00	0.31
80	600970	中材国际	86,000	1,037,160.00	0.31
81	600066	宇通客车	39,900	1,029,420.00	0.30

82	605507	国邦医药	61,100	1,017,315.00	0.30
83	000792	盐湖股份	58,000	1,012,100.00	0.30
84	002415	海康威视	32,700	1,010,757.00	0.30
85	603129	春风动力	7,100	1,010,614.00	0.30
86	000983	山西焦煤	97,800	1,008,318.00	0.30
87	002532	天山铝业	124,100	1,006,451.00	0.30
88	688772	珠海冠宇	67,011	998,463.90	0.29
89	002595	豪迈科技	25,900	988,603.00	0.29
90	000951	中国重汽	68,900	986,648.00	0.29
91	00700	腾讯控股	2,900	985,657.89	0.29
92	000883	湖北能源	161,300	969,413.00	0.29
93	002493	荣盛石化	100,350	969,381.00	0.29
94	688187	时代电气	19,486	962,218.68	0.28
95	002444	巨星科技	38,800	958,360.00	0.28
96	600529	山东药玻	37,700	955,318.00	0.28
97	600348	华阳股份	95,050	946,698.00	0.28
98	02099	中国黄金国际	20,400	932,795.47	0.28
99	600993	马应龙	34,600	922,782.00	0.27
100	600332	白云山	30,900	906,297.00	0.27
101	000598	兴蓉环境	120,500	906,160.00	0.27
102	601058	赛轮轮胎	64,700	905,800.00	0.27
103	601728	中国电信	146,700	902,205.00	0.27
104	000100	TCL 科技	203,024	877,063.68	0.26
105	600572	康恩贝	195,900	875,673.00	0.26
106	605368	蓝天燃气	64,100	874,324.00	0.26
107	000682	东方电子	79,000	872,160.00	0.26
108	603087	甘李药业	18,300	847,656.00	0.25
109	000997	新大陆	60,900	847,119.00	0.25
110	01258	中国有色矿业	136,000	845,287.71	0.25
111	000923	河钢资源	48,200	830,004.00	0.24
112	600346	恒力石化	58,500	816,075.00	0.24
113	601618	中国中冶	262,000	812,200.00	0.24
114	002027	分众传媒	130,800	792,648.00	0.23
115	603979	金诚信	15,400	778,162.00	0.23
116	600183	生益科技	36,700	772,902.00	0.23
117	300308	中际旭创	5,600	772,128.00	0.23
118	00916	龙源电力	120,000	768,841.63	0.23
119	002884	凌霄泵业	39,500	758,400.00	0.22
120	603236	移远通信	16,190	756,558.70	0.22
121	603279	景津装备	34,700	752,643.00	0.22
122	000408	藏格矿业	31,000	746,170.00	0.22

123	600028	中国石化	93,400	590,288.00	0.17
124	00386	中国石油化工股份	32,000	147,781.15	0.04
125	600582	天地科技	105,200	724,828.00	0.21
126	000922	佳电股份	60,000	715,800.00	0.21
127	603277	银都股份	23,800	714,952.00	0.21
128	00995	安徽皖通高速公路	74,000	631,483.29	0.19
129	600012	皖通高速	5,400	75,438.00	0.02
130	603195	公牛集团	8,799	678,578.88	0.20
131	601528	瑞丰银行	143,520	677,414.40	0.20
132	688677	海泰新光	17,241	676,364.43	0.20
133	002531	天顺风能	74,500	666,030.00	0.20
134	603298	杭叉集团	33,740	662,653.60	0.20
135	000739	普洛药业	48,400	656,788.00	0.19
136	002594	比亚迪	2,600	650,650.00	0.19
137	603338	浙江鼎力	10,600	640,452.00	0.19
138	688012	中微公司	4,532	640,190.32	0.19
139	002815	崇达技术	68,000	637,840.00	0.19
140	600256	广汇能源	95,100	637,170.00	0.19
141	000690	宝新能源	123,700	630,870.00	0.19
142	300054	鼎龙股份	27,800	630,504.00	0.19
143	605377	华旺科技	47,180	625,135.00	0.18
144	000811	冰轮环境	63,700	614,705.00	0.18
145	601138	工业富联	22,400	613,760.00	0.18
146	002749	国光股份	40,800	613,632.00	0.18
147	300347	泰格医药	12,600	612,360.00	0.18
148	601111	中国国航	82,800	611,064.00	0.18
149	000933	神火股份	30,200	610,946.00	0.18
150	600580	卧龙电驱	50,000	607,500.00	0.18
151	600584	长电科技	19,100	605,661.00	0.18
152	002078	太阳纸业	43,100	601,245.00	0.18
153	002429	兆驰股份	124,600	599,326.00	0.18
154	603199	九华旅游	19,900	593,020.00	0.17
155	600612	老凤祥	10,100	587,719.00	0.17
156	601666	平煤股份	51,800	580,160.00	0.17
157	600547	山东黄金	21,100	577,718.00	0.17
158	600521	华海药业	32,700	557,535.00	0.16
159	300389	艾比森	45,400	557,512.00	0.16
160	300145	中金环境	223,000	557,500.00	0.16
161	00038	第一拖拉机股份	80,000	539,576.42	0.16
162	600674	川投能源	28,200	528,750.00	0.16

163	002299	圣农发展	38,300	522,412.00	0.15
164	600998	九州通	105,754	516,079.52	0.15
165	000807	云铝股份	37,900	512,029.00	0.15
166	688019	安集科技	4,063	511,125.40	0.15
167	301367	怡和嘉业	8,147	506,743.40	0.15
168	600963	岳阳林纸	136,000	499,120.00	0.15
169	600096	云天化	25,000	485,500.00	0.14
170	000829	天音控股	52,900	480,332.00	0.14
171	000400	许继电气	13,900	478,299.00	0.14
172	01339	中国人民 保险集团	195,000	476,966.57	0.14
173	600409	三友化工	95,000	476,900.00	0.14
174	300481	濮阳惠成	34,500	476,100.00	0.14
175	600298	安琪酵母	17,000	474,810.00	0.14
176	002063	远光软件	90,100	472,124.00	0.14
177	300413	芒果超媒	22,200	463,980.00	0.14
178	000403	派林生物	16,800	447,888.00	0.13
179	600511	国药股份	14,200	437,218.00	0.13
180	601168	西部矿业	24,100	432,595.00	0.13
181	002831	裕同科技	16,900	432,471.00	0.13
182	601006	大秦铁路	59,100	423,156.00	0.12
183	01585	雅迪控股	46,000	414,374.97	0.12
184	600312	平高电气	21,300	414,285.00	0.12
185	300260	新莱应材	19,360	405,398.40	0.12
186	06198	青岛港	73,000	397,088.81	0.12
187	002352	顺丰控股	11,100	396,159.00	0.12
188	002080	中材科技	30,600	394,740.00	0.12
189	605060	联德股份	27,100	389,427.00	0.11
190	00586	海螺创业	58,500	388,692.16	0.11
191	003000	劲仔食品	31,600	380,780.00	0.11
192	600522	中天科技	23,300	369,305.00	0.11
193	601877	正泰电器	19,000	362,140.00	0.11
194	300498	温氏股份	18,200	360,724.00	0.11
195	605196	华通线缆	34,100	358,732.00	0.11
196	001914	招商积余	35,700	357,714.00	0.11
197	600025	华能水电	32,900	354,662.00	0.10
198	603368	柳药集团	20,100	351,750.00	0.10
199	601333	广深铁路	106,900	346,356.00	0.10
200	002223	鱼跃医疗	9,200	345,920.00	0.10
201	600428	中远海特	56,400	345,168.00	0.10
202	600160	巨化股份	14,300	345,059.00	0.10
203	600415	小商品城	46,100	342,062.00	0.10
204	600483	福能股份	29,100	339,306.00	0.10

205	600968	海油发展	82,000	337,840.00	0.10
206	601827	三峰环境	39,600	336,204.00	0.10
207	002463	沪电股份	9,100	332,150.00	0.10
208	603588	高能环境	52,100	327,188.00	0.10
209	300677	英科医疗	12,200	327,082.00	0.10
210	688696	极米科技	4,229	326,647.96	0.10
211	01138	中远海能	30,000	277,637.26	0.08
212	600026	中远海能	3,000	46,830.00	0.01
213	000538	云南白药	6,300	322,245.00	0.10
214	002675	东诚药业	26,200	321,212.00	0.09
215	600060	海信视像	12,700	314,198.00	0.09
216	000657	中钨高新	34,200	312,588.00	0.09
217	603606	东方电缆	6,400	312,384.00	0.09
218	000960	锡业股份	19,900	308,251.00	0.09
219	002225	濮耐股份	75,100	307,159.00	0.09
220	688789	宏华数科	2,827	304,750.60	0.09
221	605555	德昌股份	16,196	301,407.56	0.09
222	601816	京沪高铁	55,500	298,035.00	0.09
223	002864	盘龙药业	11,500	297,620.00	0.09
224	688036	传音控股	3,716	284,422.64	0.08
225	300244	迪安诊断	23,500	282,000.00	0.08
226	688377	迪威尔	21,259	278,492.90	0.08
227	600422	昆药集团	15,600	278,148.00	0.08
228	300274	阳光电源	4,480	277,894.40	0.08
229	300529	健帆生物	10,100	274,821.00	0.08
230	002035	华帝股份	43,900	273,497.00	0.08
231	688210	统联精密	12,346	273,463.90	0.08
232	688692	达梦数据	1,221	267,885.63	0.08
233	002557	洽洽食品	9,500	267,805.00	0.08
234	300251	光线传媒	31,800	267,438.00	0.08
235	06049	保利物业	10,000	263,764.52	0.08
236	002100	天康生物	37,400	259,182.00	0.08
237	002138	顺络电子	9,400	258,124.00	0.08
238	002603	以岭药业	16,500	252,945.00	0.07
239	00762	中国联通	38,000	248,668.79	0.07
240	603297	永新光学	4,100	248,009.00	0.07
241	002011	盾安环境	25,100	246,733.00	0.07
242	002841	视源股份	8,300	245,099.00	0.07
243	002839	张家港行	58,800	236,376.00	0.07
244	02669	中海物业	55,000	234,923.83	0.07
245	000060	中金岭南	54,550	231,292.00	0.07
246	300628	亿联网络	6,200	227,974.00	0.07
247	603619	中曼石油	9,300	217,806.00	0.06

248	688398	赛特新材	11,702	205,721.16	0.06
249	600050	中国联通	43,200	203,040.00	0.06
250	03690	美团-W	1,860	188,601.67	0.06
251	600029	南方航空	31,600	186,124.00	0.05
252	002738	中矿资源	6,800	182,240.00	0.05
253	688253	英诺特	4,516	172,104.76	0.05
254	603885	吉祥航空	14,000	153,860.00	0.05
255	301580	爱迪特	2,018	153,513.06	0.05
256	688612	威迈斯	5,369	142,654.33	0.04
257	600958	东方证券	16,800	127,680.00	0.04
258	301565	中仑新材	5,103	124,041.42	0.04
259	603915	国茂股份	11,300	116,277.00	0.03
260	300394	天孚通信	1,300	114,946.00	0.03
261	301589	诺瓦星云	603	113,370.03	0.03
262	09992	泡泡玛特	3,200	111,712.03	0.03
263	301261	恒工精密	3,000	111,210.00	0.03
264	300633	开立医疗	2,800	110,824.00	0.03
265	002955	鸿合科技	4,600	107,548.00	0.03
266	688799	华纳药厂	2,442	103,614.06	0.03
267	603738	泰晶科技	7,496	102,245.44	0.03
268	688668	鼎通科技	2,534	99,560.86	0.03
269	603565	中谷物流	11,100	97,014.00	0.03
270	600845	宝信软件	2,980	95,151.40	0.03
271	300174	元力股份	6,700	91,455.00	0.03
272	601882	海天精工	3,700	84,767.00	0.03
273	300682	朗新集团	7,500	63,825.00	0.02
274	603878	武进不锈	9,000	58,860.00	0.02
275	601825	沪农商行	8,600	57,792.00	0.02
276	603179	新泉股份	1,400	54,936.00	0.02
277	001286	陕西能源	3,767	43,433.51	0.01
278	603381	永臻股份	1,444	40,015.85	0.01
279	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
280	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
281	301526	国际复材	5,158	17,176.14	0.01
282	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
283	688190	云路股份	200	14,942.00	0.00
284	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
285	688709	成都华微	631	11,856.49	0.00
286	301516	中远通	604	11,252.52	0.00
287	688456	有研粉材	398	10,614.66	0.00
288	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
289	601096	宏盛华源	2,511	10,269.99	0.00
290	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00



291	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
292	301489	思泉新材	128	9,034.24	0.00
293	301459	丰茂股份	208	8,259.68	0.00
294	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
295	688584	上海合晶	492	7,817.88	0.00
296	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
297	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
298	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
299	603341	龙旗科技	170	6,373.30	0.00
300	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
301	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
302	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
303	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
304	603193	润本股份	248	4,560.72	0.00
305	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
306	000708	中信特钢	300	4,071.00	0.00
307	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
308	603325	博隆技术	51	3,471.06	0.00
309	603004	鼎龙科技	188	3,186.60	0.00
310	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
311	603312	西典新能	120	3,043.20	0.00
312	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
313	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
314	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
315	001239	永达股份	189	2,623.32	0.00
316	001358	兴欣新材	122	2,503.44	0.00

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

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	001965	招商公路	6,227,068.35	1.86
2	601225	陕西煤业	4,322,948.00	1.29
3	000521	长虹美菱	4,134,056.00	1.24
4	601699	潞安环能	3,086,553.80	0.92
5	600900	长江电力	2,659,401.00	0.80
6	600985	淮北矿业	2,356,390.00	0.71
7	000333	美的集团	2,173,319.00	0.65
8	000429	粤高速 A	2,163,847.00	0.65
9	600690	海尔智家	1,934,261.00	0.58

10	002128	电投能源	1,738,976.00	0.52
11	601088	中国神华	1,731,799.00	0.52
12	600487	亨通光电	1,702,470.00	0.51
13	301004	嘉益股份	1,606,546.00	0.48
14	600971	恒源煤电	1,581,032.13	0.47
15	601077	渝农商行	1,562,999.00	0.47
16	000726	鲁泰 A	1,403,151.00	0.42
17	000338	潍柴动力	1,397,897.00	0.42
18	603239	浙江仙通	1,367,305.00	0.41
19	600188	兖矿能源	1,349,271.00	0.40
20	600873	梅花生物	1,321,612.00	0.40

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,392,186.00	1.31
2	001965	招商公路	3,948,689.93	1.18
3	002128	电投能源	2,859,664.00	0.86
4	601225	陕西煤业	2,377,729.00	0.71
5	002318	久立特材	1,970,190.00	0.59
6	600030	中信证券	1,757,033.60	0.53
7	000975	山金国际	1,603,349.00	0.48
8	600188	兖矿能源	1,597,594.00	0.48
9	600012	皖通高速	1,558,854.00	0.47
10	688737	中自科技	1,550,404.02	0.46
11	600707	彩虹股份	1,526,930.00	0.46
12	603833	欧派家居	1,445,746.00	0.43
13	300122	智飞生物	1,439,767.00	0.43
14	603337	杰克股份	1,372,992.00	0.41
15	002092	ST 中泰	1,354,228.00	0.41
16	002749	国光股份	1,336,319.98	0.40
17	600079	人福医药	1,327,787.00	0.40
18	000429	粤高速 A	1,311,068.00	0.39
19	600546	山煤国际	1,275,179.00	0.38
20	000708	中信特钢	1,267,543.00	0.38

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	135,750,721.76
卖出股票收入（成交）总额	159,126,386.86

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	-	-
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）	1,620,483.65	0.48
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,620,483.65	0.48

## 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	113653	永 22 转债	4,550	468,852.44	0.14
2	110091	合力转债	2,150	346,505.49	0.10
3	113062	常银转债	2,370	289,977.49	0.09
4	113060	浙 22 转债	1,150	143,867.71	0.04
5	113669	景 23 转债	540	71,456.28	0.02

## 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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本，以达到降低投资组合整体风险的目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.2 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	22,132.64
2	应收清算款	76,944,395.11
3	应收股利	288,469.16

4	应收利息	-
5	应收申购款	30,599.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	77,285,596.50

#### 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	113653	永 22 转债	468,852.44	0.14
2	110091	合力转债	346,505.49	0.10
3	113062	常银转债	289,977.49	0.09
4	113060	浙 22 转债	143,867.71	0.04
5	113669	景 23 转债	71,456.28	0.02
6	118024	冠宇转债	69,082.00	0.02
7	113661	福 22 转债	65,940.30	0.02
8	111010	立昂转债	50,908.64	0.02
9	111007	永和转债	48,765.45	0.01
10	113675	新 23 转债	31,301.92	0.01
11	113059	福莱转债	26,703.01	0.01
12	118026	利元转债	7,122.92	0.00

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
南方价值臻 选混合 A	4,090	86,231.34	1,539,907.8 7	0.44%	351,146,281 .00	99.56%
南方价值臻 选混合 C	15,509	2,254.15	5,944,894.8 1	17.01%	29,014,654. 59	82.99%
合计	19,599	19,778.85	7,484,802.6 8	1.93%	380,160,935 .59	98.07%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方价值臻选混合 A	530,839.99	0.1505%
	南方价值臻选混合 C	5,578.40	0.0160%
	合计	536,418.39	0.1384%

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方价值臻选混合 A	0
	南方价值臻选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方价值臻选混合 A	0~10
	南方价值臻选混合 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C
基金合同生效日(2021年6月21日)基金份额总额	1,409,686,126.75	44,583,592.72
本报告期期初基金份额总额	373,731,393.55	20,069,502.57
本报告期基金总申购份额	1,540,591.59	25,757,816.28
减：报告期基金总赎回份额	22,585,796.27	10,867,769.45
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	352,686,188.87	34,959,549.40

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

## 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

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

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	
长城证券	1	36,542,189.58	12.45%	33,990.18	15.20%	-
中信证券	5	35,771,609.28	12.19%	21,661.43	9.68%	-
长江证券	1	31,868,903.73	10.86%	22,768.57	10.18%	-
中信建投	2	30,853,402.56	10.52%	25,710.16	11.49%	-
华安证券	1	23,434,559.10	7.99%	21,880.84	9.78%	-
华创证券	2	22,911,461.54	7.81%	11,837.27	5.29%	-
中泰证券	2	22,457,300.05	7.65%	16,197.42	7.24%	-
方正证券	2	13,054,954.91	4.45%	9,409.49	4.21%	-
国金证券	1	12,767,305.95	4.35%	9,400.72	4.20%	-

西南证券	2	11,988,466.20	4.09%	10,959.42	4.90%	-
国联证券	1	10,288,301.68	3.51%	7,325.22	3.27%	-
德邦证券	1	5,852,962.26	1.99%	5,478.40	2.45%	-
华泰证券	4	5,353,493.62	1.82%	3,979.41	1.78%	-
中金公司	2	4,548,159.42	1.55%	3,346.78	1.50%	-
招商证券	3	4,305,854.71	1.47%	2,817.21	1.26%	-
东方证券	1	3,923,527.12	1.34%	2,886.93	1.29%	-
国投证券	1	3,543,357.27	1.21%	3,317.76	1.48%	-
东北证券	2	3,312,647.32	1.13%	3,100.99	1.39%	-
国信证券	2	2,970,561.38	1.01%	1,591.92	0.71%	-
国海证券	1	2,770,255.72	0.94%	2,038.76	0.91%	-
东吴证券	1	1,860,595.92	0.63%	1,741.13	0.78%	-
申万宏源	1	1,462,100.91	0.50%	1,075.80	0.48%	-
国盛证券	1	934,324.64	0.32%	687.43	0.31%	-
海通证券	2	640,404.00	0.22%	470.58	0.21%	-
华福证券	3	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。



B: 选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比, 并根据评比的结果选择席位:

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实, 投资建议是否准确
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C: 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

新增交易单元:

无

减少交易单元:

招商证券

申万宏源

国泰君安

广发证券

### 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
长城证券	279,502.93	56.73%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	10,171.05	2.06%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	103,083.82	20.92%	77,582,000.00	100.00%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

国投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国盛证券	99,931.51	20.28%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-06
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-02
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-24
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资	上海证券报、基金管	2024-05-30

	关联方承销证券的关联交易公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
6	南方基金管理股份有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-20

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方价值臻选混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方价值臻选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方价值臻选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方价值臻选混合型证券投资基金 2024 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>