

南方兴润价值一年持有期混合型证券 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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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.....	10
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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	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.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
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.....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方兴润价值一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	南方兴润价值一年持有混合	
基金主代码	011363	
交易代码	011363	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 3 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	8,301,880,988.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方兴润价值一年持有混合 A	南方兴润价值一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	011363	011364
报告期末下属分级基金的份额总额	6,490,251,723.25 份	1,811,629,264.87 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，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，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、金融衍生品投资策略和资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+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×40%
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	兴业银行股份有限公司
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	95561
传真	0755-82763889	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	518017	200120
法定代表人	周易	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、南方兴润价值一年持有混合 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	-84,052,831.69
本期利润	444,251,573.85
加权平均基金份额本期利润	0.0663
本期加权平均净值利润率	9.71%
本期基金份额净值增长率	10.31%
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	-2,367,528,438.90
期末可供分配基金份额利润	-0.3648
期末基金资产净值	4,561,521,357.23
期末基金份额净值	0.7028
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	-29.72%

2、南方兴润价值一年持有混合 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	-26,615,843.35
本期利润	117,654,716.35
加权平均基金份额本期利润	0.0630
本期加权平均净值利润率	9.41%
本期基金份额净值增长率	9.98%
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	-683,908,359.86
期末可供分配基金份额利润	-0.3775
期末基金资产净值	1,247,487,372.58
期末基金份额净值	0.6886
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	-31.14%

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

南方兴润价值一年持有混合 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	-1.95%	0.58%	-1.57%	0.28%	-0.38%	0.30%
过去三个月	3.76%	0.72%	0.77%	0.45%	2.99%	0.27%
过去六个月	10.31%	0.71%	2.80%	0.53%	7.51%	0.18%
过去一年	-0.51%	0.61%	-3.30%	0.52%	2.79%	0.09%
过去三年	-25.83%	0.83%	-16.35%	0.63%	-9.48%	0.20%

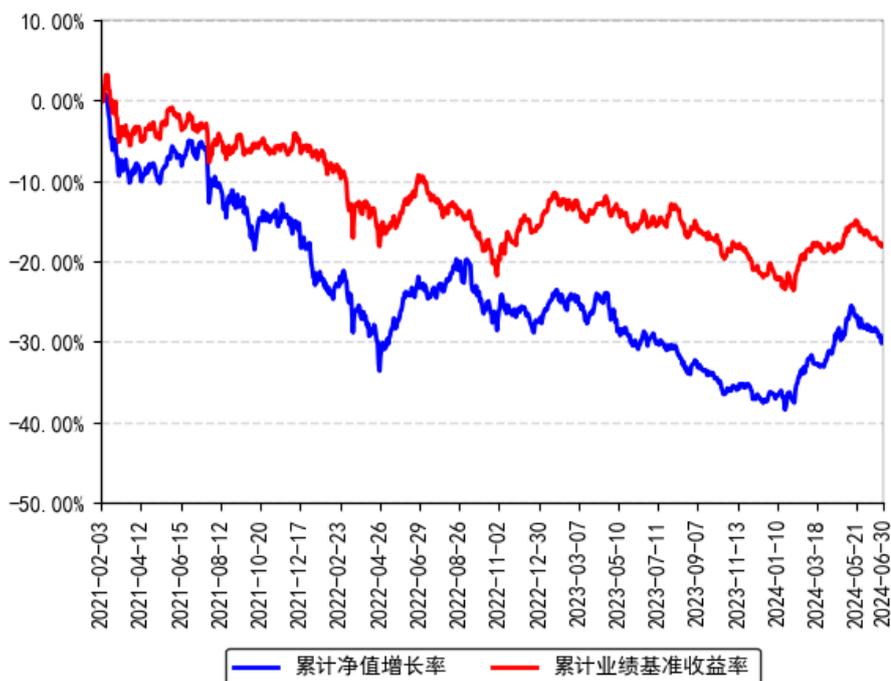
自基金合同生效起至今	-29.72%	0.82%	-18.07%	0.64%	-11.65%	0.18%
------------	---------	-------	---------	-------	---------	-------

南方兴润价值一年持有混合 C

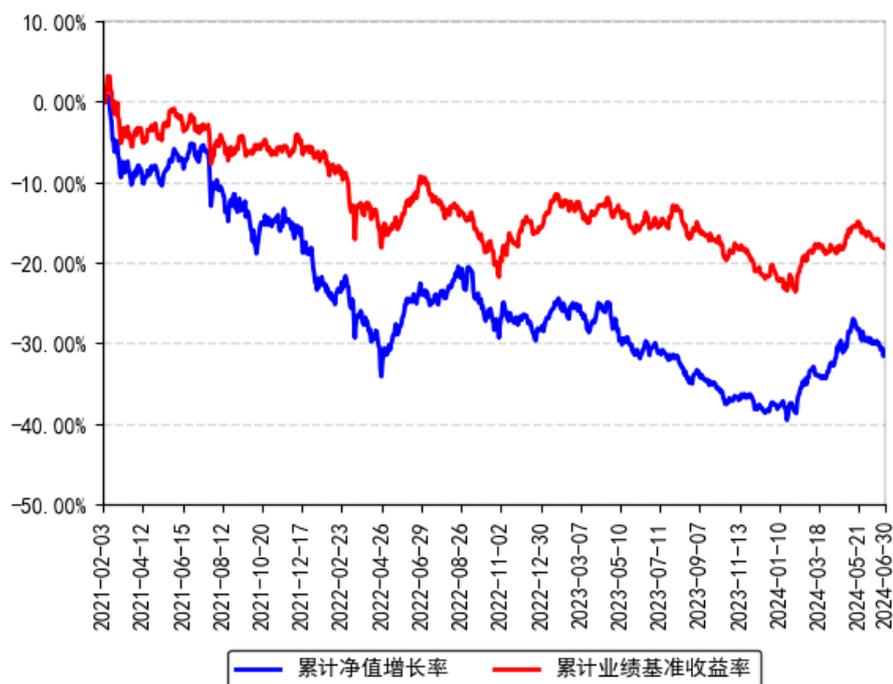
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.01%	0.58%	-1.57%	0.28%	-0.44%	0.30%
过去三个月	3.61%	0.72%	0.77%	0.45%	2.84%	0.27%
过去六个月	9.98%	0.71%	2.80%	0.53%	7.18%	0.18%
过去一年	-1.11%	0.61%	-3.30%	0.52%	2.19%	0.09%
过去三年	-27.16%	0.83%	-16.35%	0.63%	-10.81%	0.20%
自基金合同生效起至今	-31.14%	0.82%	-18.07%	0.64%	-13.07%	0.18%

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

南方兴润价值一年持有混合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



南方兴润价值一年持有混合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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
史博	本基金	2021年2	-	26年	硕士研究生学历，特许金融分析师

基金经 理	月 3 日			(CFA), 具有基金从业资格。曾任职于博时基金管理有限公司、中国人寿资产管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司。2004 年 7 月 23 日至 2005 年 2 月 25 日, 任泰达周期基金经理; 2007 年 7 月 26 日至 2009 年 5 月 23 日, 任泰达首选基金经理; 2008 年 8 月 5 日至 2009 年 9 月 25 日, 任泰达市值基金经理 2009 年 4 月 9 日至 2009 年 9 月 25 日, 任泰达品质基金经理 2009 年 10 月加入南方基金, 曾任研究部总监、总裁助理、首席投资官(权益), 现任南方基金副总裁。2014 年 2 月 26 日至 2018 年 11 月 16 日, 任南方新优享基金经理; 2015 年 9 月 11 日至 2018 年 11 月 28 日, 任南方消费活力基金经理; 2017 年 3 月 27 日至 2020 年 7 月 24 日, 任南方智慧混合基金经理 2018 年 5 月 10 日至 2020 年 7 月 24 日, 任南方瑞祥一年混合基金经理; 2019 年 3 月 12 日至 2020 年 11 月 20 日, 任南方智诚混合基金经理 2021 年 8 月 25 日至 2024 年 6 月 28 日, 任南方新能源产业趋势混合基金经理 2011 年 2 月 17 日至今, 任南方绩优基金经理; 2018 年 9 月 6 日至今, 任南方瑞合基金经理; 2021 年 2 月 3 日至今, 任南方兴润价值一年持有混合基金经理; 2021 年 2 月 10 日至今, 兼任投资经理; 2021 年 12 月 28 日至今, 任南方港股创新视野一年持有混合基金经理。
----------	-------	--	--	---

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
史博	公募基金	4	10,948,719,919.08	2004 年 07 月 23 日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	1	32,815,976,719.07	2018 年 08 月 24 日
	合计	5	43,764,696,638.1	-

			5	
--	--	--	---	--

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

今年上半年，经济发展稳中求进，继续回升向好态势。新发展理念深入人心，资本市场管理机制进一步完善，支持科技创新，助力加快构建新发展格局；鼓励上市公司提升分红派息比率，提高分红次数，助力推动高质量发展。地缘政治因素使得国际资本流向明显对A股市场不利，量化投资者又主要进行短线交易，导致国内优质公司的长期投资价值被明显低估。即便如此，今年上半年国内红利指数上涨仍然超过11%。

价值投资，长期投资，理性投资是本基金的基本投资理念。上半年本基金股票仓位逐步提升，由年初的66.7%提升到了期末的76.4%，提升了将近10个点。股市不强，超配股票的短期效果并不好，但我们对于股市的长期有信心，市场低迷时超配符合我们的投资理念。个

股选择方面，选择资产负债表稳健，经营现金流充裕，在资本开支方面自律性较强的公司是本基金当前的核心策略。在国内各行业普遍供需环境苛刻的背景下，依然有许多优秀上市公司不谋求单纯的规模扩张，不追求同质化“内卷”，而是努力构建客户友好，产业链安全，且在目标市场上地位稳固的企业生态。耐心持有优质企业，先赚分红收益。等待企业厚积薄发，熬过周期底部，与企业共成长。企业的长期成长曲线是非线性的，潜龙在渊，勤勉打磨，缓而不怠，终将铸造辉煌。今年以来，新能源汽车及汽车零部件，家用电器，煤炭及通信运营商领域，是本基金的主要配置方向。

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 0.7028 元，报告期内，份额净值增长率为 10.31%，同期业绩基准增长率为 2.80%；本基金 C 份额净值为 0.6886 元，报告期内，份额净值增长率为 9.98%，同期业绩基准增长率为 2.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

改革不停步。二十届三中全会圆满落下帷幕，会议成果丰硕，为我国未来发展指明了方向。会议明确提出，科技创新是推动我国经济社会发展的重中之重。为了实现科技创新的突破，我们必须举全国之力，集中力量进行攻关。在这一背景下，传统行业的发展模式亟待转型。传统行业企业需要放慢扩张步伐，由过去单纯追求规模扩张转向提高盈利质量，实现真正的经济效益，赚取真金白银。在此基础上，传统企业应更多地回馈股东，增加分红，这样才能够确保有充足的资金和优秀的人才源源不断地流入新兴产业，为我国科技创新注入活力。

创新为王。新质生产力的发展正在快马加鞭，展现出勃勃生机。这些新兴的生产力不用外界扬鞭催促，便自发地加快了前进的步伐，展现出了强烈的内生动力和发展潜力。然而，由于这些新质生产力还处于投入期，其对于当期总量经济的拉动作用尚不明显，尚未成为推动经济增长的主力军。

开放不止步。出口方面，形势一片大好。上半年，我国进出口规模在历史同期的数据中首次超过了 21 万亿元的大关，进出口增速呈现出逐季加快的良好态势。这一成绩的取得，无疑是中国企业在全球市场中竞争力不断提升的结果，也是我国对外开放政策成效的体现。同时，地缘政治隐忧依然，下半年海外选情对出口有怎样的影响存在不确定性。

风险要关注。在全社会形成了广泛的共识之下，部分高负债运行的地产企业陷入了岌岌可危的境地，它们的财务状况危如累卵，随时可能崩溃，成为了经济发展的拖累项。这些企业的问题不仅影响了自身的健康发展，也对整个经济体系造成了不小的压力，成为了宏观经济中不可忽视的风险点。

综上所述，虽然当前经济形势复杂多变，但通过积极应对挑战，加强内部管理，优化产业结构，中国经济将持续健康发展，优质公司的长期投资价值将逐步被市场认可。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方兴润价值一年持有期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	131,185,080.38	165,652,270.24
结算备付金		676,538.41	669,926.35
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	4,742,668,434.87	4,075,321,883.51
其中：股票投资		4,436,090,997.71	3,772,332,358.92
基金投资		-	-
债券投资		306,577,437.16	302,989,524.59
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	980,000,000.00	1,432,830,993.99
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		-	-
应收股利		9,654,053.24	109,732.07
应收申购款		11,548.46	5,866.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		5,864,195,655.36	5,674,590,673.01
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		43,231,926.10	-
应付赎回款		4,406,597.79	15,135,639.43
应付管理人报酬		5,830,803.84	5,763,578.78
应付托管费		971,800.64	960,596.46
应付销售服务费		626,397.00	618,599.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	119,400.18	120,184.14
负债合计		55,186,925.55	22,598,598.09
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	8,301,880,988.12	8,904,439,342.48
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	-2,492,872,258.31	-3,252,447,267.56
净资产合计		5,809,008,729.81	5,651,992,074.92
负债和净资产总计		5,864,195,655.36	5,674,590,673.01

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，南方兴润价值一年持有混合 A 份额净值 0.7028 元，基金份额总额 6,490,251,723.25 份；南方兴润价值一年持有混合 C 份额净值 0.6886 元，基金份额总额 1,811,629,264.87 份；总份额合计 8,301,880,988.12 份。

6.2 利润表

会计主体：南方兴润价值一年持有期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		606,339,873.54	-116,182,578.75
1.利息收入		13,225,468.75	14,020,186.54
其中：存款利息收入	6.4.3.9	380,097.46	2,492,342.40
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		12,845,371.29	11,527,844.14
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-79,460,560.45	-56,876,285.00
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-199,374,584.48	-118,897,722.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	3,564,912.57	928,169.38
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	116,349,111.46	61,093,268.22
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	672,574,965.24	-73,326,480.29
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.3.15	-	-
减：二、营业总支出		44,433,583.34	72,732,772.01
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	34,733,031.29	57,846,757.23
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.6.2.2	5,788,838.57	9,641,126.19
3.销售服务费	6.4.6.2.3	3,726,843.88	5,015,237.86
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		-	103.45

8.其他费用	6.4.3.16	184,869.60	229,547.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		561,906,290.20	-188,915,350.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		561,906,290.20	-188,915,350.76
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		561,906,290.20	-188,915,350.76

6.3 净资产变动表

会计主体：南方兴润价值一年持有期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	8,904,439,342.48	-	-3,252,447,267.56	5,651,992,074.92
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	8,904,439,342.48	-	-3,252,447,267.56	5,651,992,074.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-602,558,354.36	-	759,575,009.25	157,016,654.89
（一）、综合收益总额	-	-	561,906,290.20	561,906,290.20
（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）	-602,558,354.36	-	197,668,719.05	-404,889,635.31
其中：1.基金申购款	6,260,156.69	-	-2,062,773.80	4,197,382.89
2.基金赎回款	-608,818,511.05	-	199,731,492.85	-409,087,018.20
（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	8,301,880,988.12	-	-2,492,872,258.31	5,809,008,729.81
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	11,169,672,295.68	-	-3,083,655,958.84	8,086,016,336.84
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	11,169,672,295.68	-	-3,083,655,958.84	8,086,016,336.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,184,960,925.86	-	130,045,226.08	-1,054,915,699.78
（一）、综合收益总额	-	-	-188,915,350.76	-188,915,350.76
（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）	-1,184,960,925.86	-	318,960,576.84	-866,000,349.02
其中：1.基金申购款	8,488,874.45	-	-2,296,186.45	6,192,688.00
2.基金赎回款	-1,193,449,800.31	-	321,256,763.29	-872,193,037.02
（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	9,984,711,369.82	-	-2,953,610,732.76	7,031,100,637.06

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 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	14,125,307.48
等于：本金	14,123,640.66
加：应计利息	1,666.82
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	117,059,772.90
等于：本金	117,039,296.36
加：应计利息	20,476.54
减：坏账准备	-
合计	131,185,080.38

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,953,905,083.51	-	4,436,090,997.71	482,185,914.20
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	300,335,850.00	6,230,437.16	306,577,437.16
	合计	300,335,850.00	6,230,437.16	306,577,437.16
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,254,240,933.51	6,230,437.16	4,742,668,434.87	482,197,064.20

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	980,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	980,000,000.00	-

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	119,344.68
其他	55.50
合计	119,400.18

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方兴润价值一年持有混合 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	6,967,248,803.83	6,967,248,803.83
本期申购	5,083,629.33	5,083,629.33
本期赎回（以“-”号填列）	-482,080,709.91	-482,080,709.91
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	6,490,251,723.25	6,490,251,723.25

南方兴润价值一年持有混合 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	1,937,190,538.65	1,937,190,538.65
本期申购	1,176,527.36	1,176,527.36
本期赎回（以“-”号填列）	-126,737,801.14	-126,737,801.14
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	1,811,629,264.87	1,811,629,264.87

注：红利再投及转入份额计入本期申购，转出份额计入本期赎回。

6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

南方兴润价值一年持有混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,463,372,814.07	-64,773,477.77	-2,528,146,291.84

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-2,463,372,814.07	-64,773,477.77	-2,528,146,291.84
本期利润	-84,052,831.69	528,304,405.54	444,251,573.85
本期基金份额交易产生的变动数	179,897,206.86	-24,732,854.89	155,164,351.97
其中：基金申购款	-1,926,187.82	258,468.06	-1,667,719.76
基金赎回款	181,823,394.68	-24,991,322.95	156,832,071.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,367,528,438.90	438,798,072.88	-1,928,730,366.02

南方兴润价值一年持有混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-705,999,515.80	-18,301,459.92	-724,300,975.72
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-705,999,515.80	-18,301,459.92	-724,300,975.72
本期利润	-26,615,843.35	144,270,559.70	117,654,716.35
本期基金份额交易产生的变动数	48,706,999.29	-6,202,632.21	42,504,367.08
其中：基金申购款	-464,047.06	68,993.02	-395,054.04
基金赎回款	49,171,046.35	-6,271,625.23	42,899,421.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-683,908,359.86	119,766,467.57	-564,141,892.29

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	36,610.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	336,874.66
结算备付金利息收入	6,612.06
其他	-
合计	380,097.46

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

6.4.3.10 股票投资收益

单位：人民币元

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

卖出股票成交总额	2,113,472,925.69
减：卖出股票成本总额	2,307,962,150.06
减：交易费用	4,885,360.11
买卖股票差价收入	-199,374,584.48

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	3,564,912.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	3,564,912.57

6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

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	116,349,111.46
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	116,349,111.46

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	672,574,965.24
——股票投资	672,551,965.24
——债券投资	23,000.00
——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	672,574,965.24

6.4.3.15 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	59,672.34
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	10,080.87
其他	36,844.05
合计	184,869.60

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，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、登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	基金托管人、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
兴业证券	4,410,900,873.01	100.00%	9,513,323,650.14	100.00%

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
兴业证券	-	-	3,185,162.54	100.00%

6.4.6.1.3 债券回购交易

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
兴业证券	140,063,000,000.00	100.00%	116,175,363,000.00	100.00%

6.4.6.1.4 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。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
兴业证券	2,449,452.29	100.00%	-	-
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
兴业证券	5,397,678.34	100.00%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围符合《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	34,733,031.29	57,846,757.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	16,414,087.13	27,374,826.98
应支付基金管理人的净管理费	18,318,944.16	30,471,930.25

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：

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

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	5,788,838.57	9,641,126.19

注：于 2023 年 7 月 10 日前，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的 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，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

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		
	南方兴润价值一年持有混合 A	南方兴润价值一年持有混合 C	合计
南方基金	-	37,533.82	37,533.82
兴业银行	-	3,341,261.56	3,341,261.56
兴业证券	-	342,158.08	342,158.08
合计	-	3,720,953.46	3,720,953.46
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		
	南方兴润价值一年持有混合 A	南方兴润价值一年持有混合 C	合计
南方基金	-	44,569.17	44,569.17
兴业银行	-	4,492,357.11	4,492,357.11
兴业证券	-	471,778.62	471,778.62
合计	-	5,008,704.90	5,008,704.90

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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.60\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
兴业银行-银行存款	14,125,307.48	36,610.74	95,729,783.21	329,873.70
兴业证券-券商保证金	117,059,772.90	336,874.66	369,962,398.92	1,697,467.42

注：

1. 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。
2. 本基金的券商保证金为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 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	10,448	163,929.12
华泰联合	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
华泰联合	603312	西典新能	网下申购	1,296	37,609.92
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	113666	爱玛转债	配债	12,340	1,234,000.00
华泰联合	688472	阿特斯	网下申购	62,602	694,882.20
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
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	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
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	137,994	785,185.86

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.8 期末（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	691	87,680.99	129,914.91	-
301589	诺瓦星云	2024 年 5 月 30 日	1-6 个月（含）	锁定期转增	-	188.01	553	-	103,969.53	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定期	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
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	1 个月内（含）	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-

		26 日								
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股锁定期	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
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	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
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	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股锁定期	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
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	-
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	-
688695	中创股份	2024	6 个月	新股锁	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-

		年 3 月 6 日		定期						
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定期	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
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	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股锁定期	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
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	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定期	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
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	-
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	-
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. 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。

2. 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。

3. 基金作为特定投资者，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。

4. 基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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。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净资产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。

于本期末，本基金的卖出回购金融资产款(若有)计息且利息金额不重大；除此之外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，该部分账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，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，本基金的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本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的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	131,185,080.38	-	-	-	131,185,080.38
结算备付金	676,538.41	-	-	-	676,538.41
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	306,577,437.16	-	-	4,436,090,997.71	4,742,668,434.87
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	980,000,000.00	-	-	-	980,000,000.00
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	9,654,053.24	9,654,053.24
应收申购款	-	-	-	11,548.46	11,548.46
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,418,439,055.95	-	-	4,445,756,599.41	5,864,195,655.36
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	-	-	-	43,231,926.10	43,231,926.10
应付赎回款	-	-	-	4,406,597.79	4,406,597.79
应付管理人报酬	-	-	-	5,830,803.84	5,830,803.84
应付托管费	-	-	-	971,800.64	971,800.64
应付销售服务费	-	-	-	626,397.00	626,397.00
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	-	-	-	119,400.18	119,400.18
负债总计	-	-	-	55,186,925.55	55,186,925.55
利率敏感度缺口	1,418,439.055.95	-	-	4,390,569.673.86	5,809,008.729.81
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	165,652,270.24	-	-	-	165,652,270.24
结算备付金	669,926.35	-	-	-	669,926.35
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	302,989,524.59	-	-	3,772,332.358.92	4,075,321.883.51
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,432,830.993.99	-	-	-	1,432,830.993.99
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	109,732.07	109,732.07
应收申购款	-	-	-	5,866.85	5,866.85
递延所得税	-	-	-	-	-

资产					
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,902,142,71 5.17	-	-	3,772,447,95 7.84	5,674,590,67 3.01
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	-	-	-	15,135,639.4 3	15,135,639.4 3
应付管理人 报酬	-	-	-	5,763,578.78	5,763,578.78
应付托管费	-	-	-	960,596.46	960,596.46
应付销售服 务费	-	-	-	618,599.28	618,599.28
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	-	-	-	120,184.14	120,184.14
负债总计	-	-	-	22,598,598.0 9	22,598,598.0 9
利率敏感度 缺口	1,902,142,71 5.17	-	-	3,749,849,35 9.75	5,651,992,07 4.92

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	-108,574.81	-24,789.88
2.市场利率平行下降25个基点	108,656.18	26,292.96	

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					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	1,154,492,466.84	-	-	-	1,154,492,466.84
资产合计	-	1,154,492,466.84	-	-	-	1,154,492,466.84
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	-	1,154,492,466.84	-	-	-	1,154,492,466.84

项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	1,038,804,413.79	-	-	-	1,038,804,413.79
资产合计	-	1,038,804,413.79	-	-	-	1,038,804,413.79
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	-	1,038,804,413.79	-	-	-	1,038,804,413.79

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%	57,724,623.34	51,940,220.69
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-57,724,623.34	-51,940,220.69	

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%）。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	4,436,090,997.71	76.37	3,772,332,358.92	66.74
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	4,436,090,997.71	76.37	3,772,332,358.92	66.74

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%	150,284,920.14	151,662,100.15
	2. 沪深 300 下降 5%	-150,284,920.14	-151,662,100.15

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	4,435,577,046.57
第二层次	306,623,048.27
第三层次	468,340.03
合计	4,742,668,434.87

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	4,436,090,997.71	75.65
	其中：股票	4,436,090,997.71	75.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	306,577,437.16	5.23
	其中：债券	306,577,437.16	5.23
	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	980,000,000.00	16.71
	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	131,861,618.79	2.25
8	其他各项资产	9,665,601.70	0.16
9	合计	5,864,195,655.36	100.00

注：本基金本报告期末通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 1,154,492,466.84 元，占基金资产净值比例 19.87%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	479,506,178.58	8.25
C	制造业	2,482,083,192.01	42.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	134,363,682.36	2.31
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,962,984.00	0.03

I	信息传输、软件和信息技术服务业	123,590,425.92	2.13
J	金融业	50,137,206.00	0.86
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,990,510.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	5,964,352.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,281,598,530.87	56.49

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	-	-
材料	143,682,035.05	2.47
工业	20,453,158.80	0.35
非必需消费品	58,228,984.00	1.00
必需消费品	-	-
医疗保健	117,841,189.30	2.03
金融	95,540,611.03	1.64
科技	36,293,121.78	0.62
通讯	575,758,866.20	9.91
公用事业	-	-
房地产	106,694,500.68	1.84
政府	-	-
合计	1,154,492,466.84	19.87

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	600066	宇通客车	16,580,535	427,777,803.00	7.36
2	00941	中国移动	4,640,000	326,082,310.40	5.61
3	600941	中国移动	452,796	48,675,570.00	0.84
4	601225	陕西煤业	13,552,860	349,257,202.20	6.01
5	601058	赛轮轮胎	23,003,898	322,054,572.00	5.54
6	00762	中国联通	38,154,000	249,676,555.80	4.30
7	000333	美的集团	3,613,689	233,082,940.50	4.01

8	601088	中国神华	2,547,300	113,023,701.00	1.95
9	01088	中国神华	3,248,000	106,569,627.81	1.83
10	000921	海信家电	6,325,052	203,919,676.48	3.51
11	00921	海信家电	250,000	5,863,969.00	0.10
12	600060	海信视像	7,360,925	182,109,284.50	3.13
13	01530	三生制药	20,049,000	117,841,189.30	2.03
14	000521	长虹美菱	13,797,353	104,583,935.74	1.80
15	00005	汇丰控股	1,480,800	92,307,213.96	1.59
16	689009	九号公司	2,374,579	87,408,252.99	1.50
17	000338	潍柴动力	4,097,900	66,549,896.00	1.15
18	02338	潍柴动力	1,500,000	20,453,158.80	0.35
19	600690	海尔智家	3,000,000	85,140,000.00	1.47
20	300750	宁德时代	452,696	81,498,860.88	1.40
21	688188	柏楚电子	405,678	74,867,874.90	1.29
22	688569	铁科轨道	3,599,690	74,405,592.30	1.28
23	603518	锦泓集团	8,295,300	72,998,640.00	1.26
24	000786	北新建材	2,166,200	64,249,492.00	1.11
25	002154	报喜鸟	11,756,100	63,953,184.00	1.10
26	06049	保利物业	2,405,800	63,456,468.22	1.09
27	002938	鹏鼎控股	1,574,400	62,598,144.00	1.08
28	605368	蓝天燃气	4,201,899	57,313,902.36	0.99
29	09992	泡泡玛特	1,500,000	52,365,015.00	0.90
30	003816	中国广核	11,262,000	52,143,060.00	0.90
31	002475	立讯精密	1,285,900	50,548,729.00	0.87
32	000915	华特达因	1,543,979	46,566,406.64	0.80
33	688253	英诺特	1,199,649	45,718,623.39	0.79
34	603889	新澳股份	5,618,730	43,488,970.20	0.75
35	01070	TCL 电子	6,292,000	36,293,121.78	0.62
36	02669	中海物业	6,580,000	28,105,432.99	0.48
37	601528	瑞丰银行	5,629,400	26,570,768.00	0.46
38	002236	大华股份	1,651,588	25,533,550.48	0.44
39	600886	国投电力	1,365,500	24,906,720.00	0.43
40	600096	云天化	1,058,300	20,552,186.00	0.35
41	600582	天地科技	2,765,000	19,050,850.00	0.33
42	01258	中国有色矿业	3,021,000	18,776,574.77	0.32
43	300677	英科医疗	688,600	18,461,366.00	0.32
44	300740	水羊股份	1,252,410	18,385,378.80	0.32
45	02099	中国黄金国际	401,000	18,335,832.47	0.32
46	601939	建设银行	2,107,970	15,598,978.00	0.27
47	02869	绿城服务	4,920,000	15,132,599.47	0.26
48	002832	比音勒芬	522,750	12,634,867.50	0.22

49	601500	通用股份	2,280,260	12,176,588.40	0.21
50	000951	中国重汽	802,040	11,485,212.80	0.20
51	301589	诺瓦星云	56,766	11,032,913.44	0.19
52	601699	潞安环能	556,800	10,094,784.00	0.17
53	601398	工商银行	1,397,800	7,967,460.00	0.14
54	000975	山金国际	437,722	7,130,491.38	0.12
55	605305	中际联合	234,360	6,044,144.40	0.10
56	300384	三联虹普	454,600	5,964,352.00	0.10
57	000404	长虹华意	786,400	4,191,512.00	0.07
58	002027	分众传媒	658,500	3,990,510.00	0.07
59	03618	重庆农村商 业银行	925,000	3,233,397.07	0.06
60	002884	凌霄泵业	131,800	2,530,560.00	0.04
61	605108	同庆楼	91,900	1,962,984.00	0.03
62	301276	嘉曼服饰	49,890	1,045,694.40	0.02
63	301526	国际复材	9,723	32,377.59	0.00
64	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
65	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
66	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
67	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
68	601096	宏盛华源	3,918	16,024.62	0.00
69	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
70	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
71	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
72	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
73	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
74	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
75	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
76	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
77	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
78	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
79	301568	思泰克	246	7,827.72	0.00
80	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
81	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
82	688720	艾森股份	165	6,689.10	0.00
83	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
84	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
85	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
86	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
87	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
88	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
89	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
90	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00

91	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
92	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
93	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
94	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
95	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
96	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	00762	中国联通	238,680,874.68	4.22
2	601225	陕西煤业	164,920,035.96	2.92
3	01530	三生制药	111,690,298.28	1.98
4	689009	九号公司	98,774,899.16	1.75
5	06049	保利物业	91,299,814.13	1.62
6	00005	汇丰控股	88,852,729.98	1.57
7	603518	锦泓集团	84,214,267.00	1.49
8	300750	宁德时代	82,766,847.42	1.46
9	601088	中国神华	69,077,899.00	1.22
10	688188	柏楚电子	66,145,581.57	1.17
11	000338	潍柴动力	65,305,992.00	1.16
12	000786	北新建材	65,143,538.94	1.15
13	600066	宇通客车	63,555,112.08	1.12
14	02669	中海物业	55,379,292.01	0.98
15	09992	泡泡玛特	51,601,038.96	0.91
16	600060	海信视像	50,826,230.37	0.90
17	002938	鹏鼎控股	50,761,349.96	0.90
18	002475	立讯精密	49,002,923.40	0.87
19	000333	美的集团	47,435,684.80	0.84
20	600941	中国移动	46,003,140.61	0.81

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	00941	中国移动	290,708,427.08	5.14

2	600519	贵州茅台	220,017,194.00	3.89
3	02367	巨子生物	127,016,232.54	2.25
4	00992	联想集团	115,507,963.05	2.04
5	002698	博实股份	115,026,752.04	2.04
6	002258	利尔化学	89,412,747.46	1.58
7	000625	长安汽车	84,900,990.70	1.50
8	600761	安徽合力	82,889,727.27	1.47
9	000975	山金国际	80,101,702.00	1.42
10	002675	东诚药业	58,626,929.80	1.04
11	00981	中芯国际	56,616,835.49	1.00
12	603198	迎驾贡酒	51,571,292.12	0.91
13	01171	兖矿能源	50,165,408.88	0.89
14	601001	晋控煤业	47,551,268.99	0.84
15	688111	金山办公	46,132,061.43	0.82
16	01585	雅迪控股	44,375,901.05	0.79
17	000915	华特达因	42,474,159.66	0.75
18	688041	海光信息	37,333,444.41	0.66
19	605196	华通线缆	35,648,113.00	0.63
20	688700	东威科技	34,162,169.37	0.60

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	2,299,168,823.61
卖出股票收入（成交）总额	2,113,472,925.69

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	306,577,437.16	5.28
	其中：政策性金融债	306,577,437.16	5.28
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	306,577,437.16	5.28

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	230306	23 进出 06	1,000,000	101,657,240.44	1.75
2	190409	19 农发 09	900,000	92,763,442.62	1.60
3	220322	22 进出 22	600,000	61,227,491.80	1.05
4	230411	23 农发 11	500,000	50,929,262.30	0.88

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	9,654,053.24
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,548.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,665,601.70

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方兴润价值一年持有混合 A	66,007	98,326.72	13,745,854.70	0.21%	6,476,505,868.55	99.79%
南方兴润价值一年持有混合 C	18,496	97,947.08	3,155,933.62	0.17%	1,808,473,331.25	99.83%
合计	84,503	98,243.62	16,901,788.32	0.20%	8,284,979,199.80	99.80%

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	南方兴润价值一年持有混合 A	4,593,636.24	0.0708%
	南方兴润价值一年持有混合 C	70,100.00	0.0039%
	合计	4,663,736.24	0.0562%

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	南方兴润价值一年持有混合 A	>100
	南方兴润价值一年持有混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	南方兴润价值一年持有混合 A	>100
	南方兴润价值一年持有混合 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方兴润价值一年持有混合 A	南方兴润价值一年持有混合 C
基金合同生效日(2021 年 2 月 3 日)基金份额总额	11,704,724,143.34	3,164,327,289.03
本报告期期初基金份额总额	6,967,248,803.83	1,937,190,538.65
本报告期基金总申购份额	5,083,629.33	1,176,527.36
减：报告期基金总赎回份额	482,080,709.91	126,737,801.14
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	6,490,251,723.25	1,811,629,264.87

§ 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。

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金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	
兴业证券	2	4,410,900,873.01	100.00%	2,449,452.29	100.00%	-

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：

无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

兴业证券	-	-	140,063,000,000.00	100.00%	-	-
------	---	---	--------------------	---------	---	---

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部分基金 2024 年非港股通交易日申购赎回等业务安排的公告	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	2024-01-18
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	2024-02-02
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	2024-02-24
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-30
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兴润价值一年持有期混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方兴润价值一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《南方兴润价值一年持有期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、《南方兴润价值一年持有期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>