

南华丰汇混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:南华基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年2月28日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	3
1.1 重要提示	3
1.2 目录	4
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产（基金净值）变动表	21
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§9 开放式基金份额变动	56
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南华丰汇混合型证券投资基金
基金简称	南华丰汇混合
基金主代码	015245
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年02月28日
基金管理人	南华基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	9,020,362.57份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,通过合理的资产配置,综合运用多种投资策略,力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	<p>本基金把握宏观经济和投资市场的变化趋势,动态调整投资组合比例,自上而下配置资产,有效分散风险,力求获取超额收益。</p> <p>1、资产配置策略; 2、股票投资策略; 3、债券投资策略; 4、资产支持证券投资策略; 5、衍生品投资策略; 6、存托凭证投资策略。</p>
业绩比较基准	70%×沪深300指数收益率+30%×中债综合全价(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金属于混合型基金,风险水平和预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

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	南华基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 姓名	吴海燕	陆志俊

露负责人	联系电话	010-58965800	95559
	电子邮箱	services@nanhuafunds.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-810-5599	95559
传真		010-58965908	021-62701216
注册地址		浙江省东阳市横店影视产业 实验区商务楼	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址		浙江省杭州市上城区横店大 厦801室	中国（上海）长宁区仙霞路1 8号
邮政编码		310008	200336
法定代表人		朱坚	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.nanhuafunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南华基金管理有限公司	浙江省杭州市上城区横店大厦801室

§ 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期
	（2022年02月28日（基金合同生效日）- 2022年06月30日）
本期已实现收益	1,329,698.32

本期利润	2,358,234.62
加权平均基金份额本期利润	0.0695
本期加权平均净值利润率	6.84%
本期基金份额净值增长率	16.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)
期末可供分配利润	374,305.20
期末可供分配基金份额利润	0.0415
期末基金资产净值	10,473,850.09
期末基金份额净值	1.1611
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	16.11%

注：（1）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；

（2）上述基金业绩指标不包括持有人认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；

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

（4）本基金合同生效日期为2022年02月28日。

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

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	9.88%	1.35%	6.59%	0.75%	3.29%	0.60%
过去三个月	8.74%	1.35%	4.54%	1.00%	4.20%	0.35%
自基金合同生效起至今	16.11%	1.21%	-1.11%	1.11%	17.22%	0.10%

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



注：

(1) 本基金基金合同生效日为2022年2月28日，截至本报告披露时点，本基金基金合同生效不满1年。

(2) 本基金的建仓期为2022年2月28日至2022年8月27日，截至本报告期末，本基金仍处于建仓期，建仓期结束时本基金各项资产配置比例应符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

南华基金管理有限公司于2016年10月18日经中国证监会核准设立，于2016年11月17日经工商注册登记成立，是国内第一家由期货公司全资控股的公募基金管理公司，股东为南华期货股份有限公司。公司注册资本2.0亿元，注册地为浙江省东阳市横店影视产业实验区商务楼。

截止报告期末，南华基金管理有限公司旗下共管理14只公募基金，分别为南华瑞盈混合型发起式证券投资基金、南华丰淳混合型证券投资基金、南华瑞鑫定期开放债券型

发起式证券投资基金、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金、南华瑞扬纯债债券型证券投资基金、南华瑞恒中短债债券型证券投资基金、南华瑞元定期开放债券型发起式证券投资基金、南华价值启航纯债债券型证券投资基金、南华瑞泽债券型证券投资基金、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金、南华瑞利债券型证券投资基金、南华丰汇混合型证券投资基金及南华瑞诚一年定期开放债券型发起式证券投资基金，资产管理规模约104.61亿元。

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		
刘斐	本基金基金经理	2022-02-28	-	14	硕士研究生，具有基金从业资格。2008年至2009年，任职于天相投资顾问有限公司，担任研究员。2009年至2012年，任职于国都证券有限责任公司，担任研究员。2012年至2013年，任职于长城证券股份有限公司，担任研究员。2013年至2015年，任职于东兴证券股份有限公司，担任研究员。2015年至2017年，任职于泓德基金管理有限公司，担任研究员。2017年3月加入南华基金管理有限公司，曾任南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金经理（2017年8月16日至2022年7月13日止）、

					南华瑞扬纯债债券型证券投资基金基金经理（2020年5月27日至2022年7月13日止）、南华丰汇混合型证券投资基金基金经理（2022年2月28日至2022年7月13日止）、南华价值启航纯债债券型证券投资基金基金经理（2022年4月7日至2022年7月13日止）。曾任南华丰淳混合型证券投资基金基金经理（2017年12月26日起至2021年6月3日止）、南华瑞恒中短债债券型证券投资基金基金经理（2021年4月21日至2022年6月30日止）。
黄志钢	本基金基金经理	2022-03-05	-	17	硕士研究生，具有基金从业资格。2004年7月5日至2005年7月14日在美国未来之路任交易员，2005年7月15日至2006年12月10日任海通期货研究发展部研究员，2006年12月10日至2008年10月21日任国元证券衍生产品部高级经理，2008年10月21日至2015年6月5日任国联安基金量化投资部基金经理，2015年6月8日至2018年6月30日任金鹰基金指数及量化投资部总经理，2019年1月1日至2019年8月1日任南华期货研究所量化投资总监，201

					<p>9年8月入职南华基金管理有限公司，现任公司总经理助理兼量化投资部总经理。现任南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2022年1月29日起任职）、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2022年1月29日起任职）、南华丰汇混合型证券投资基金联接基金基金经理（2022年3月5日起任职）。</p>
康冬	本基金基金经理助理	2022-03-10	-	5	<p>博士研究生，具有基金从业资格。曾先后工作于中航证券有限公司风险管理部和南华期货股份有限公司基金部，于2020年1月13日入职南华基金管理有限公司量化投资部，先后担任研究员、投资经理助理。曾任南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理（2022年3月15日至2022年8月26日止）、南华瑞泽债券型证券投资基金基金经理助理（2021年12月11日至2022年8月26日止）、南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金经理助理（2021年12月11日至2022年8月26日止）、南华瑞恒中短债债</p>

				<p>券型证券投资基金基金经理助理（2022年6月24日至2022年8月26日止）、南华瑞扬纯债债券型证券投资基金基金经理助理（2022年3月15日至2022年8月26日止）、南华丰淳混合型证券投资基金基金经理助理（2022年7月21日至2022年8月26日止）、南华瑞利债券型证券投资基金基金经理助理（2022年3月28日至2022年8月26日止，2022年3月15日至2022年3月27日任职南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金经理助理，南华瑞利纯债债券型证券投资基金后转型为南华瑞利债券型证券投资基金）。现任南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理（2021年12月11日起任职），南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理（2021年12月11日起任职）、南华丰汇混合型证券投资基金基金经理助理（2022年3月10日起任职）。</p>
--	--	--	--	---

注：

（1）基金经理刘斐的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理黄志钢的任职日期是指公司做出决定后公告之日；

- (2) 基金经理刘斐已于2022年7月13日离任，离任日期为公司作出决定后公告之日；
- (2) 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；
- (3) 本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》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，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

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《南华基金管理有限公司公平交易管理细则》的规定，通过系统和人工等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投资组合。

在投资决策内部控制方面，本基金管理人确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度，通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式，使不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行控制方面，本基金管理人实行集中交易制度，交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先，价格优先的原则严格执行所有指令，确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易，按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

本报告期内，公司对不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合向交易的差价进行分析，未发现违反公平交易原则的异常情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制及监控制度，报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

一、大类资产配置策略

本产品2022年2月28日成立，在2022年二季度，逐步完成了股票的目标仓位配置。根据当前大的经济周期形态和A股底层结构特征变迁判断，通过自上而下的方法来进行股票择时的难度在加大，对组合的贡献度在降低；而通过自下而上的研究创造的阿尔法收益，长期来看，能有效消化阶段性系统下跌的风险。综合来看，择时的性价比在下降，放弃择时，盯住目标股票仓位配置，可能是当前大类资产配置策略的一个不错的选择。

综合考虑流动性管理和组合净值波动，股票的目标仓位设置在88%-90%，另外5%左右的仓位配置在流动性好、性价比高且长期能带来较好绝对回报的可转换债券上。

二、股票投资策略及运作

从业以来，尝试过主动的自下而上的价值投资，也尝试过传统的多因子量化投资，体会颇多。主动价值投资，需要对行业、公司有着深入的研究，并以此为基础，形成独立的认知，而这种认知往往是独特的，与市场的主流观点不一致，因此主动价值投资方法本质上是一种对个股研究的强者思维模式，是自我认知能力的变现。主动价值投资方法注重对个股的深度研究，大多会放弃对个股广度上的覆盖，投资组合往往会在风格、行业上趋于集中，由此带来组合的高波动性，需要强大的心理素质与之相匹配；另一方面，对独特认知的强调，也增加了认知上不可避免的盲区所带来的风险，由于缺乏相对灵活的纠错机制，一旦看错，纠错的成本会非常大。

而传统的多因子量化投资方法，不同于主动价值投资“行业-公司”的研究范式，是从因子的视角来进行组合投资，通过控制组合在因子上的暴露，来获取超额收益。这本质上是一种对个股研究的弱者思维模式，通过组合上广泛覆盖，利用大数定律的机理，从而发挥出因子效应。而因子有效性的验证，通常是通过历史数据去回测，这种归纳验证的逻辑也是量化策略被广泛诟病的原因。

通过多年的总结和反思，体会到主动价值投资理念和量化投资技术手段的融合非常重要。一方面价值投资理念符合投资的第一性原理，也是投资领域的公理；另一方面，通过量化的技术手段，可以充分发挥量化选股在广度上的优势。

从投资的第一性原理来看，投资复利的实现是通过企业以净资产回报率为主要锚定目标，以资产负债表持续扩张为手段，以企业持续成长的结果来完成的。从长期来看，二级市场股票的投资收益率跟企业的净资产回报率大体保持一致。因此投资的关键是以预期合理的价格买入预期净资产回报率高的企业。

对于企业未来中长期净资产回报率的预测是一件非常困难的事情，需要对行业格局变化、企业发展趋势有高超独到的洞见力，而企业中短期的净资产回报率的变化趋势往往表现出一定的惯性特征，预测也相对容易。通过对上市公司的单季度盈利增速进行分析，也佐证了企业具有季度盈利动量效应的统计特征。基于此，形成了我们“动态EP-ROE”的投资框架。具体来讲，就是运用量化的方法，实时跟踪上市公司的EP和ROE的边际变化，选择动态EP较高（对应估值水平较低）且动态ROE较高的股票构建投资组合。

运用上述“动态EP-ROE”的投资框架，在行业上选择景气度持续向上的顺周期行业，二季度我们重点配置了新能源、煤炭和农化等行业；在个股层面，选择行业内具有估值优势的高成长性企业。在此基础上，通过对组合的持续调整优化，从而分享企业高速成长的红利和中国经济高质量发展的红利。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末南华丰汇混合基金份额净值为1.1611元，本报告期内，基金份额净值增长率为16.11%，同期业绩比较基准收益率为-1.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前大的宏观经济处在减速换挡的“L”型结构的走平阶段，在此宏观大背景下，经济周期在空间上的波动会压缩到一个比较窄幅的区间，大概率上，未来5-10年GDP会维持在4%-6%的增速区间；经济周期在时间上的跨度也会显著压缩，更多表现为库存周期。经济周期在空间和时间形态上变迁背后的一个重要原因是中国经济内部结构的重大变化，中国从一个投资驱动为主的经济体逐步过渡到消费驱动为主的经济体，从2021年GDP的贡献度来看，消费对GDP的拉动贡献度已经超过65%；中国经济的产业结构由过去传统制造为主逐步过渡到“高端制造、数字经济”占优。这种经济内部结构的重大变迁，使得中国经济能穿越周期，经济的韧性在增强。从今年5月份的经济数据来看，各项经济指标从疫情影响中快速恢复，也佐证了中国经济的强大韧性。

A股的底层成分股构成发生了重要的结构性变化。随着科创板的开通和北交所的设立，大量医药、高端制造、电子等弱周期、高成长公司上市，A股可供选择的优秀投资标的持续扩容，A股整体的成长性更强，周期性进一步弱化，为阿尔法选股提供了肥沃的土壤。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期存在连续超过60个工作日基金资产净值低于五千万的情形，时间段为2022年3月11日至2022年6月30日。根据2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会提交解决方案。

§ 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，交通银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在南华丰汇混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律、法规和基金合同及托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告期内，由南华基金管理有限公司编制、本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南华丰汇混合型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末
----	-----	-----

		2022年06月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	567,623.11
结算备付金		86,602.34
存出保证金		2,985.04
交易性金融资产	6.4.7.2	9,773,781.90
其中：股票投资		9,173,043.40
基金投资		-
债券投资		600,738.50
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		216,077.70
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		10,647,070.09
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日
负 债：		
短期借款		-

交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		87,007.09
应付管理人报酬		5,185.40
应付托管费		864.21
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		17.34
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	80,145.96
负债合计		173,220.00
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	9,020,362.57
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	1,453,487.52
净资产合计		10,473,850.09
负债和净资产总计		10,647,070.09

注：

报告截止日2022年6月30日，基金份额净值1.1611元，基金份额总额9,020,362.57份。

6.2 利润表

会计主体：南华丰汇混合型证券投资基金

本报告期：2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年02月28日（基金合同 生效日）至2022年06月30 日

一、营业总收入		2,491,773.09
1. 利息收入		107,889.47
其中：存款利息收入	6.4.7.9	103,777.55
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		4,111.92
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-225,635.11
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-394,695.39
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	93,976.81
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	75,083.47
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）	6.4.7.16	1,028,536.30
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,580,982.43
减：二、营业总支出		133,538.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	58,281.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,713.55
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
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		6.72

8. 其他费用	6. 4. 7. 18	65, 536. 75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2, 358, 234. 62
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2, 358, 234. 62
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		2, 358, 234. 62

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南华丰汇混合型证券投资基金

本报告期：2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	202, 729, 068. 62	-	-	202, 729, 068. 62
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	202, 729, 068. 62	-	-	202, 729, 068. 62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-193, 708, 70 6. 05	-	1, 453, 487. 52	-192, 255, 21 8. 53
（一）、综合收益总额	-	-	2, 358, 234. 62	2, 358, 234. 62
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减	-193, 708, 70 6. 05	-	-904, 747. 10	-194, 613, 45 3. 15

少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	18,225,227.37	-	1,246,837.71	19,472,065.08
2. 基金赎回款	-211,933,933.42	-	-2,151,584.81	-214,085,518.23
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	9,020,362.57	-	1,453,487.52	10,473,850.09

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:

朱坚

连省

母学贤

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 基金基本情况

南华丰汇混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3686号《关于准予南华丰汇混合型证券投资基金注册的批复》核准,由南华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币202,713,916.79元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第0198号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》于2022年2月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为202,713,916.79份基金份额,其中认购资金利息折合15,151.83份基金份额。本基金的基金管理人为南华基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）和存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、股指期货、国债期货、货币市场工具、同业存单、银行存款以及现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票、存托凭证的比例占基金资产的60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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、存出保证金及应收申购款等。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为70%×沪深300指数收益率+30%×中债综合全价（总值）指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人南华基金管理有限公司于2022年8月30日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2022年06月30日的财务状况以及2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2022年2月28日（基金合同生效日）至2022年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认

列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	567,623.11
等于：本金	567,410.37
加：应计利息	212.74
减：坏账准备	-
定期存款	0.00
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	567,623.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		8,153,779.89	-	9,173,043.40	1,019,263.51
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	589,822.31	1,643.40	600,738.50	9,272.79
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	589,822.31	1,643.40	600,738.50	9,272.79
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		8,743,602.20	1,643.40	9,773,781.90	1,028,536.30

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	182.05
应付交易费用	16,252.52
其中：交易所市场	16,252.52
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	63,711.39
合计	80,145.96

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	202,729,068.62	202,729,068.62
本期申购	18,225,227.37	18,225,227.37
本期赎回（以“-”号填列）	-211,933,933.42	-211,933,933.42
本期末	9,020,362.57	9,020,362.57

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,329,698.32	1,028,536.30	2,358,234.62
本期基金份额交易产生的变动数	-955,393.12	50,646.02	-904,747.10
其中：基金申购款	1,012,398.36	234,439.35	1,246,837.71
基金赎回款	-1,967,791.48	-183,793.33	-2,151,584.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	374,305.20	1,079,182.32	1,453,487.52

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日
活期存款利息收入	26,506.39
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	77,263.36
其他	7.80
合计	103,777.55

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日
卖出股票成交总额	9,620,435.93
减：卖出股票成本总额	9,982,912.11

减：交易费用	32,219.21
买卖股票差价收入	-394,695.39

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年 06月30日
债券投资收益——利息收入	3,919.54
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	90,057.27
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	93,976.81

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,202,270.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,102,213.36
减：应计利息总额	9,906.39
减：交易费用	93.91
买卖债券差价收入	90,057.27

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	75,083.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	75,083.47

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	1,028,536.30
——股票投资	1,019,263.51
——债券投资	9,272.79
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

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	1,028,536.30

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日
基金赎回费收入	1,580,941.20
转换费收入	41.23
合计	1,580,982.43

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日
审计费用	24,039.12
信息披露费	39,672.27
汇划手续费	1,425.36
证券开户费	400.00
合计	65,536.75

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 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者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
南华基金管理有限公司(“南华基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人
南华期货股份有限公司(“南华期货公司”)	基金管理人的股东、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	58,281.45
其中：支付销售机构的客户维护费	14,109.25

注：支付基金管理人南华基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 \times 0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,713.55

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 \times 0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	567,623.11	26,506.39

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。

本基金的基金管理人建立了全面风险管理体系，在董事会下设立风险控制委员会，根据公司总体战略负责拟订公司风险战略和风险管理政策，并对其实施情况及效果进行监督和评价，指导公司的风险管理和内控制度建设；对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估；监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评估公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和通行的会计标准。在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责制定公司经营管理中的风险控制政策，组织制定公司经营管理中的内部风险控制制度；对公司在投资、市场、信用、操作等方面的风险控制情况进行监督；以及对公司经营管理过程中的风险状况进行定期或不定期评估。在业务操作层面，监察稽核部负责公司旗下基金及其它受托资产投资中的风险识别、评估和控制并承担其他风险的管理职责，负责在各业务部门一线风险控制的基础上实施风险再控制。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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、日常的量化报告等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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金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，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日
AAA	169,599.33
AAA以下	431,139.17
未评级	-
合计	600,738.50

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%。

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6.4.12。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得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 6月30	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----------------------	------	------	------	-----	----

日					
资产					
银行存款	567,623.11	-	-	-	567,623.11
结算备付金	86,602.34	-	-	-	86,602.34
存出保证金	2,985.04	-	-	-	2,985.04
交易性金融资产	17,668.32	425,863.88	157,206.30	9,173,043.40	9,773,781.90
应收申购款	-	-	-	216,077.70	216,077.70
资产总计	674,878.81	425,863.88	157,206.30	9,389,121.10	10,647,070.09
负债					
应付赎回款	-	-	-	87,007.09	87,007.09
应付管理人报酬	-	-	-	5,185.40	5,185.40
应付托管费	-	-	-	864.21	864.21
应交税费	-	-	-	17.34	17.34
其他负债	-	-	-	80,145.96	80,145.96
负债总计	-	-	-	173,220.00	173,220.00
利率敏感度缺口	674,878.81	425,863.88	157,206.30	9,215,901.10	10,473,850.09

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年6月30日，本基金持仓债券均为可转债，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，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。本基金的投资组合中股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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，其中现金类资产不包括结算备付金、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，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	9,173,043.40	87.58
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	600,738.50	5.74
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	9,773,781.90	93.32

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注7.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)
		本期末 2022年06月30日
	业绩比较基准上升5%	782,710.82
	业绩比较基准下降5%	-782,710.82

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日
第一层次	9,773,781.90
第二层次	-
第三层次	-
合计	9,773,781.90

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 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或金融负债。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,173,043.40	86.16
	其中：股票	9,173,043.40	86.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	600,738.50	5.64
	其中：债券	600,738.50	5.64
	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	654,225.45	6.14
8	其他各项资产	219,062.74	2.06
9	合计	10,647,070.09	100.00

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

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	186,246.00	1.78
B	采矿业	784,176.00	7.49
C	制造业	6,992,938.40	66.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	201,750.00	1.93
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	97,920.00	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	96,152.00	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	174,212.00	1.66
J	金融业	117,560.00	1.12
K	房地产业	99,207.00	0.95
L	租赁和商务服务业	206,672.00	1.97
M	科学研究和技术服务业	103,990.00	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	112,220.00	1.07
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	9,173,043.40	87.58

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	000970	中科三环	7,700	144,606.00	1.38
2	601615	明阳智能	3,700	125,060.00	1.19
3	300390	天华超净	1,400	122,360.00	1.17
4	300401	花园生物	7,000	121,380.00	1.16
5	000822	山东海化	11,600	117,856.00	1.13
6	300803	指南针	2,000	117,560.00	1.12
7	000762	西藏矿业	2,100	117,453.00	1.12
8	002407	多氟多	2,400	117,384.00	1.12
9	002125	湘潭电化	6,800	115,872.00	1.11
10	300037	新宙邦	2,200	115,632.00	1.10
11	600089	特变电工	4,200	115,038.00	1.10
12	603077	和邦生物	26,900	114,594.00	1.09
13	600438	通威股份	1,900	113,734.00	1.09
14	600392	盛和资源	5,000	113,000.00	1.08
15	002549	凯美特气	6,200	112,220.00	1.07
16	002709	天赐材料	1,800	111,708.00	1.07
17	300224	正海磁材	7,300	111,690.00	1.07
18	000799	酒鬼酒	600	111,486.00	1.06
19	300101	振芯科技	5,400	111,456.00	1.06
20	300343	联创股份	7,300	110,887.00	1.06
21	300332	天壕环境	9,900	110,880.00	1.06
22	600328	中盐化工	4,700	110,685.00	1.06
23	300568	星源材质	3,800	110,352.00	1.05
23	002182	云海金属	4,400	110,352.00	1.05

25	300346	南大光电	3,000	107,940.00	1.03
26	603676	卫信康	10,600	106,848.00	1.02
27	600596	新安股份	4,920	106,518.00	1.02
28	600206	有研新材	5,500	106,370.00	1.02
29	000629	攀钢钒钛	27,900	106,020.00	1.01
30	300601	康泰生物	2,340	105,721.20	1.01
31	300071	福石控股	32,300	105,298.00	1.01
32	601958	金钼股份	11,900	105,196.00	1.00
33	603968	醋化股份	5,100	105,060.00	1.00
34	000625	长安汽车	6,060	104,959.20	1.00
35	300477	合纵科技	13,600	104,720.00	1.00
36	600063	皖维高新	13,800	104,604.00	1.00
37	002460	赣锋锂业	700	104,090.00	0.99
38	002597	金禾实业	2,400	103,992.00	0.99
39	603259	药明康德	1,000	103,990.00	0.99
40	300196	长海股份	5,500	103,895.00	0.99
41	600096	云天化	3,300	103,884.00	0.99
42	002009	天奇股份	5,600	103,600.00	0.99
43	000831	五矿稀土	3,300	103,125.00	0.98
44	300739	明阳电路	6,400	102,528.00	0.98
45	000565	渝三峡 A	15,800	102,068.00	0.97
46	600415	小商品城	18,200	101,374.00	0.97
47	002497	雅化集团	3,100	101,215.00	0.97
48	600141	兴发集团	2,300	101,177.00	0.97
49	002167	东方锆业	13,800	101,016.00	0.96
50	300160	秀强股份	12,400	100,812.00	0.96
51	300398	飞凯材料	4,400	100,584.00	0.96
52	002378	章源钨业	12,400	100,192.00	0.96
53	603379	三美股份	4,500	100,125.00	0.96
54	002466	天齐锂业	800	99,840.00	0.95

55	002646	天佑德酒	5,200	99,580.00	0.95
56	600177	雅戈尔	15,000	99,450.00	0.95
57	600639	浦东金桥	7,300	99,207.00	0.95
58	600648	外高桥	7,200	97,920.00	0.93
59	002562	兄弟科技	15,100	97,848.00	0.93
60	002658	雪迪龙	13,800	97,014.00	0.93
60	000063	中兴通讯	3,800	97,014.00	0.93
62	000553	安道麦A	8,000	96,880.00	0.92
63	600370	三房巷	27,600	96,876.00	0.92
64	600428	中远海特	20,200	96,152.00	0.92
65	002645	华宏科技	4,400	96,008.00	0.92
66	600251	冠农股份	9,000	95,940.00	0.92
67	000960	锡业股份	5,700	95,589.00	0.91
68	603585	苏利股份	4,900	95,207.00	0.91
69	000733	振华科技	700	95,179.00	0.91
70	600497	驰宏锌锗	18,300	94,977.00	0.91
71	002109	兴化股份	16,600	94,952.00	0.91
72	600395	盘江股份	10,800	94,716.00	0.90
73	000737	北方铜业	14,900	93,870.00	0.90
74	600758	辽宁能源	21,300	93,720.00	0.89
75	000552	靖远煤电	21,700	93,527.00	0.89
76	600371	万向德农	7,000	93,450.00	0.89
77	002555	三七互娱	4,400	93,412.00	0.89
78	000878	云南铜业	8,200	93,398.00	0.89
79	600486	扬农化工	700	93,296.00	0.89
80	002041	登海种业	4,400	92,796.00	0.89
81	002204	大连重工	21,200	92,644.00	0.88
82	688196	卓越新能	1,200	92,400.00	0.88
83	601899	紫金矿业	9,900	92,367.00	0.88
84	002192	融捷股份	600	92,220.00	0.88

85	002258	利尔化学	3,900	92,118.00	0.88
86	002267	陕天然气	13,000	90,870.00	0.87
87	600714	金瑞矿业	7,200	90,360.00	0.86
88	688099	晶晨股份	800	80,800.00	0.77
89	688200	华峰测控	200	71,280.00	0.68

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	193,831.00	1.85
2	300037	新宙邦	190,287.00	1.82
3	002624	完美世界	186,024.00	1.78
4	600141	兴发集团	178,293.00	1.70
5	002555	三七互娱	176,967.00	1.69
6	000762	西藏矿业	161,598.00	1.54
7	300196	长海股份	154,340.00	1.47
8	000731	四川美丰	151,666.00	1.45
9	603077	和邦生物	147,731.00	1.41
10	300661	圣邦股份	131,067.00	1.25
11	300760	迈瑞医疗	120,573.00	1.15
12	000960	锡业股份	111,149.00	1.06
13	002460	赣锋锂业	110,309.00	1.05
14	600639	浦东金桥	108,679.00	1.04
15	600371	万向德农	105,670.00	1.01
16	601899	紫金矿业	105,028.00	1.00
17	600177	雅戈尔	104,515.00	1.00
18	688196	卓越新能	103,530.00	0.99
19	603777	来伊份	102,325.00	0.98
20	002041	登海种业	102,242.00	0.98

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002624	完美世界	189,089.00	1.81
2	000731	四川美丰	154,751.00	1.48
3	300750	宁德时代	145,600.00	1.39
4	600481	双良节能	132,484.00	1.26
5	600389	江山股份	118,430.00	1.13
6	300760	迈瑞医疗	115,942.00	1.11
7	300217	东方电热	106,658.00	1.02
8	300661	圣邦股份	103,320.00	0.99
9	600780	通宝能源	98,728.00	0.94
10	603777	来伊份	98,611.00	0.94
11	002539	云图控股	96,118.00	0.92
12	601225	陕西煤业	95,400.00	0.91
13	600233	圆通速递	95,232.00	0.91
14	600617	国新能源	95,159.00	0.91
15	002136	安纳达	94,629.00	0.90
16	600123	兰花科创	93,940.00	0.90
17	300327	中颖电子	93,077.00	0.89
18	601619	嘉泽新能	92,475.00	0.88
19	601038	一拖股份	91,401.00	0.87
20	601339	百隆东方	90,903.00	0.87

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	18,136,692.00
卖出股票收入（成交）总额	9,620,435.93

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	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)	600,738.50	5.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	600,738.50	5.74

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	占基金资产净值比例(%)
1	127045	牧原转债	310	39,989.95	0.38
2	127049	希望转2	250	30,703.91	0.29
3	128042	凯中转债	200	24,710.93	0.24
4	110057	现代转债	200	24,177.84	0.23
5	113024	核建转债	200	23,953.23	0.23

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未进行股指期货的投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货的投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 报告期内本基金不存在投资超出基金合同规定的备选股票库之外的股票的情形。

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
1	存出保证金	2,985.04
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	216,077.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	219,062.74

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	占基金资产净值比例 (%)
1	127045	牧原转债	39,989.95	0.38
2	127049	希望转2	30,703.91	0.29
3	128042	凯中转债	24,710.93	0.24
4	110057	现代转债	24,177.84	0.23
5	113024	核建转债	23,953.23	0.23
6	113516	苏农转债	23,900.96	0.23
7	128144	利民转债	23,864.74	0.23
8	110080	东湖转债	23,659.53	0.23
9	127020	中金转债	23,482.67	0.22
10	113549	白电转债	23,475.95	0.22
11	127035	濮耐转债	23,420.62	0.22
12	123129	锦鸡转债	23,409.91	0.22
13	128037	岩土转债	23,359.22	0.22
14	127005	长证转债	23,147.58	0.22
15	127025	冀东转债	22,959.73	0.22
16	113017	吉视转债	22,914.30	0.22
17	127012	招路转债	22,845.42	0.22
18	110063	鹰19转债	22,622.90	0.22
19	113044	大秦转债	21,811.62	0.21
20	123099	普利转债	17,909.51	0.17
21	128014	永东转债	17,668.32	0.17
22	123119	康泰转2	17,430.12	0.17
23	128035	大族转债	16,922.77	0.16
24	127006	敖东转债	16,724.36	0.16

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

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
467	19,315.55	939,818.71	10.42%	8,080,543.86	89.58%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	957,329.64	10.6130%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年02月28日)基金份额总额	202,729,068.62
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	18,225,227.37
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	211,933,933.42
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,020,362.57

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，王明德先生于2022年6月27日起不再担任本基金管理人南华基金管理有限公司的副总经理。前述人事变动已按规定进行备案并公告。

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

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，未发生涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

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，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到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	
申万宏源	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	19,606,838.88	70.64%	14,339.17	70.64%	-
招商	2	8,150,289.05	29.36%	5,960.23	29.36%	-

证券						
----	--	--	--	--	--	--

注：

1、交易单元的选择标准：

- (1) 证券经营机构经营业务全面，资力雄厚，信誉良好且财务状况良好；
- (2) 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，建立相关业务利益冲突防范机制，完善隔离墙制度，确保研究、投行服务客观公正，并能满足基金资金投资运作高度保密的要求；
- (3) 研究实力强，有独立的研究部门，能提供宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、推荐模拟组合、债券分析报告、个股分析报告及其他专门报告。

2、证券交易单元选择程序由基金管理人研究部发起立项申请，并联合相关部门根据评分标准对拟选择证券经营机构从不同角度进行评估、打分；研究部汇总评分结果，呈报公司领导审批后，基金管理人与选定证券经营机构签订证券交易单元租用协议。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	3,611,397.97	73.81%	43,460,000.00	100.00%	-	-	-	-
招商证券	1,281,607.72	26.19%	-	-	-	-	-	-

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	南华丰汇混合型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网	2022-02-18
2	南华丰汇混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-02-18
3	南华丰汇混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站、上海证券交易所网站	2022-02-18

4	南华基金管理有限公司南华丰汇混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-02-18
5	南华基金管理有限公司南华丰汇混合型证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-02-18
6	南华基金管理有限公司南华丰汇混合型证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-02-18
7	关于南华丰汇混合型证券投资基金参与部分代销机构开展的认购费率优惠活动的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-02-21
8	南华基金管理有限公司关于南华丰汇混合型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-02-25
9	南华丰汇混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-01
10	南华丰汇混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-05
11	南华丰汇混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-05
12	关于南华丰汇混合型证券投资基金参与部分代销机构开展的申购费率优惠及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-05
13	南华基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-10
14	南华丰汇混合型证券投资基	中国证监会基金电子披露网	2022-03-10

	金基金产品资料概要更新	站、基金管理人网站	
15	南华丰汇混合型证券投资基金招募说明书（更新）2022 年第1号	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-10
16	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-25
17	南华基金管理有限公司关于南华丰汇混合型证券投资基金开展直销柜台申购费率优惠活动的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-25
18	南华基金管理有限公司关于南华丰汇混合型证券投资基金新增交通银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-04-08
19	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增财咨道信息技术有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-04-08
20	南华基金管理有限公司关于南华丰汇混合型证券投资基金新增华龙证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-04-19
21	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-05-18

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022/2/28-2022/3/16	-	49,999,000.00	49,999,000.00	-	-
	2	2022/2/28-2022/3/14	-	45,001,375.00	45,001,375.00	-	-
个人	1	2022/3/25-2022/6/30	-	3,518,379.24	610,000.00	2,908,379.24	32.24%
产品特有风险							
<p>基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>(1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；</p> <p>(2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；</p> <p>(3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；</p> <p>(4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；</p> <p>(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。</p>							

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) 中国证监会准予南华丰汇混合型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《南华丰汇混合型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《南华丰汇混合型证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内南华丰汇混合型证券投资基金在指定报刊披露的各项公告原稿。

12.2 存放地点

杭州市上城区横店大厦801室南华基金管理有限公司

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查询，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询: www.nanhuafunds.com

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人南华基金管理有限公司,咨询电话 400-810-5599。

南华基金管理有限公司
二〇二二年八月三十日