

# 南华丰汇混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 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:2023 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2023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2023年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	60
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§8 基金份额持有人信息	62

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
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 .....	62
§9 开放式基金份额变动 .....	63
§10 重大事件揭示 .....	63
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
10.4 基金投资策略的改变 .....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
10.8 其他重大事件 .....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
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 .....	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
§12 备查文件目录 .....	69
12.1 备查文件目录 .....	69
12.2 存放地点 .....	69
12.3 查阅方式 .....	69

## §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	84,862,043.09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
信息披露负责	姓名	路秀妍	陆志俊
	联系电话	0571-26896596	95559

人	电子邮箱	services@nanhuafunds.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-810-5599	95559
传真		010-56108133	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		张哲	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
	（2023年01月01日- 2023年06月30日）
本期已实现收益	2,998,554.15
本期利润	4,984,281.35
加权平均基金份额本期利润	0.1507

本期加权平均净值利润率	12.75%
本期基金份额净值增长率	20.11%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)
期末可供分配利润	14,190,737.70
期末可供分配基金份额利润	0.1672
期末基金资产净值	105,203,303.26
期末基金份额净值	1.2397
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	23.97%

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；

## 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	4.76%	0.86%	0.88%	0.61%	3.88%	0.25%
过去三个月	4.80%	0.81%	-3.32%	0.58%	8.12%	0.23%
过去六个月	20.11%	0.81%	-0.08%	0.59%	20.19%	0.22%
过去一年	6.77%	1.06%	-9.67%	0.69%	16.44%	0.37%
自基金合同生效起至今	23.97%	1.10%	-10.67%	0.82%	34.64%	0.28%

### 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



## §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2.5亿元，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15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、南华瑞诚一年定期开放债券型发起式证券投资基金及南华瑞富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195.60亿元。

#### 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		
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，2019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）。
康冬	本基金基金经理助理	2022-03-10	-	5	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

					<p>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）基金经理黄志钢的任职日期是指公司做出决定后公告之日；
- （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合同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

2023年二季度，在国内经济复苏不及预期，美联储加息存在不确定性等多重影响下，A股整体震荡下行，市场核心指数普遍走低。其中，上证指数下跌2.16%，中证500跌幅为5.38%，创业板50在核心指数中跌幅最大，下跌8.78%。分行业看，31个申万一级行业中，只有7个行业上涨，其中，与大模型相关性较高的通信和传媒行业涨幅最大，商贸零售、食品饮料和建筑材料等行业跌幅最大。

本报告期内，市场行情出现较大的分化，这无疑增加了注重平衡型投资的难度。但是从长期的视角来看，相对平衡的投资在投资的长期回报、产品净值回撤的控制会相对更好，给持有人的体验也更友好。

本报告期，继续采取相对平衡的投资方法，秉持中庸的投资理念。这里的中庸，不是简单的“不偏不倚，折中调和”，而是古希腊哲学的“Golden Mean”，也就是找到全局合理的比例，中庸而不平庸。

在仓位管理上保持中庸。仓位管理的本质上是一个择时的问题。大多数研究表明，择时长期来看是不能创造收益的，虽然股票资产是长期回报最高的资产，高仓位长期是

受益的，但是股票资产也是波动较大的资产，中短期具有极大的不确定性。因此，放弃择时，跟随市场的平均仓位是一个不错的选择。目前本产品的股票仓位管理方法就是盯住偏股混合型基金的平均仓位。

在选股思路上保持中庸。从一个比较长期的视角来看，市场有效性会不断提升，价值投资符合投资的第一性原理，是长期有效的策略。价值投资的核心是“好公司、好价格”，而绝大多数时间，“好公司”和“好价格”不可能同时存在，我们从公司长期的潜在收益率出发，在“好公司”和“好价格”之间找到一个最佳的平衡，使得长期业绩最优而不是某些年份业绩最优。

在交易层面保持中庸。当前市场的投资者结构决定还存在较大的交易性阿尔法，而交易是有交易成本和冲击成本的，同时过度重视交易性阿尔法，也会牺牲部分选股阿尔法。我们的策略是在公募基金的交易环境中找到一个较合理的交易换手率水平，在交易性收益和交易成本之间取得最佳平衡。

投资是一个不断决策的过程，尽量将决策用量化的方法固定下来，形成框架体系，使之可复制，可回测，可预期。对于确实需要单点决策，遇事不决，中庸哲学，选择中间路线的解决之道，不急不徐，目标是不犯错误，这样才能走得更稳健。

#### 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1.2397元，本报告期内，基金份额净值增长率为20.11%，同期业绩比较基准收益率为-0.08%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7月政治局会议召开，特别提出“活跃资本市场，提振投资者信心”，随着相关政策的落地，将对A股下半年的行情起到提振作用。此外，会议还强调，要积极扩大国内需求，提振汽车、电子产品、家居等大宗消费；大力推动现代化产业体系建设，推动数字经济与先进制造业、现代服务业深度融合，促进人工智能安全发展；坚持“两个毫不动摇”，切实提高国有企业核心竞争力，切实优化民营企业发展环境。从流动性上看，政治局会议定调后北向资金持续流入，随着美联储加息接近尾声，下半年或迎来外资的稳定流入。随着后续的稳增长政策逐步实施，以及中报业绩落地，也将迎来更多的增量资金入市。A股当前估值尚处于合理范围，随着经济回暖，有望带动下半年A股市场震荡上行，其中消费、TMT和中特估有望成为下半年的三条投资主线。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 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。

本基金报告期存在连续超过 20 个工作日基金资产净值低于五千万的情形，时间段为 2023 年 4 月 13 日至 2023 年 5 月 25 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，本基金管理人已在定期报告中予以披露。

## §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”）在南华丰汇混合型发起式证券投资基金（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、基金合同和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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,440,719.90	903,105.10
结算备付金		234,783.92	4,133.17
存出保证金		22,105.34	3,927.54
交易性金融资产	6.4.7.2	96,309,043.14	10,194,321.97
其中：股票投资		95,020,816.27	9,186,979.01
基金投资		-	-
债券投资		1,288,226.87	1,007,342.96
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	1,157,000.00	-
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		2,451,469.77	1,498.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		106,615,122.07	11,106,985.98
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		1,124,548.87	-
应付赎回款		37,478.82	43,546.36
应付管理人报酬		36,038.77	4,881.68
应付托管费		6,006.46	813.60
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		31.21	19.47
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	207,714.68	151,357.44
负债合计		1,411,818.81	200,618.55
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	84,862,043.09	10,566,771.22
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	20,341,260.17	339,596.21
净资产合计		105,203,303.26	10,906,367.43
负债和净资产总计		106,615,122.07	11,106,985.98

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额净值1.2397元，基金份额总额84,862,043.09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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 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		5,134,083.68	2,491,773.09
1.利息收入		20,922.34	107,889.47
其中：存款利息收入	6.4.7.9	19,539.11	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		1,383.23	4,111.92
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		3,014,228.81	-225,635.11
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,492,959.77	-394,695.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	69,588.24	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	451,680.80	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	1,985,727.20	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	113,205.33	1,580,982.43
<b>减：二、营业总支出</b>		149,802.33	133,538.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	115,185.39	58,281.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,197.57	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		15.11	6.72
8. 其他费用	6.4.7.18	15,404.26	65,536.75
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		4,984,281.35	2,358,234.62
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		4,984,281.35	2,358,234.62
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		4,984,281.35	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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023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）	10,566,771.22	-	339,596.21	10,906,367.43
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）	10,566,771.22	-	339,596.21	10,906,367.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	74,295,271.87	-	20,001,663.96	94,296,935.83
（一）、综合收益总额	-	-	4,984,281.35	4,984,281.35
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	74,295,271.87	-	15,017,382.61	89,312,654.48
其中：1.基金申购款	93,196,214.18	-	18,445,324.50	111,641,538.68
2.基金赎回款	-18,900,942.31	-	-3,427,941.89	-22,328,884.20
（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)	84,862,043.09	-	20,341,260.17	105,203,303.26
项目	上年度可比期间 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)	-	-	-	-
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)	-193,708,706.05	-	1,453,487.52	-192,255,218.53
(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(净值减少以“-”号填列)	-193,708,706.05	-	-904,747.10	-194,613,453.15
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2023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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 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	
	2023年06月30日	
活期存款	6,440,719.90	
等于：本金	6,437,050.61	
加：应计利息	3,669.29	
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	6,440,719.90	

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动



股票		93,493,930.48	-	95,020,816.27	1,526,885.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,296,849.25	3,963.87	1,288,226.87	-12,586.25
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,296,849.25	3,963.87	1,288,226.87	-12,586.25
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		94,790,779.73	3,963.87	96,309,043.14	1,514,299.54

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,157,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,157,000.00	-

##### 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
----	-----

	2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	50.63
应付交易费用	162,787.66
其中：交易所市场	162,787.66
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	44,876.39
合计	207,714.68

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,566,771.22	10,566,771.22
本期申购	93,196,214.18	93,196,214.18
本期赎回（以“-”号填列）	-18,900,942.31	-18,900,942.31
本期末	84,862,043.09	84,862,043.09

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
本期期初	786,359.99	-446,763.78	339,596.21
本期利润	2,998,554.15	1,985,727.20	4,984,281.35
本期基金份额交易产生的变动数	10,405,823.56	4,611,559.05	15,017,382.61
其中：基金申购款	13,018,096.76	5,427,227.74	18,445,324.50
基金赎回款	-2,612,273.20	-815,668.69	-3,427,941.89
本期已分配利润	-	-	-

本期末	14,190,737.70	6,150,522.47	20,341,260.17
-----	---------------	--------------	---------------

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	18,067.02
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	1,374.92
其他	97.17
合计	19,539.11

#### 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
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	107,510,347.84
减：卖出股票成本总额	104,671,064.26
减：交易费用	346,323.81
买卖股票差价收入	2,492,959.77

#### 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
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	5,872.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	63,716.17
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	69,588.24
----	-----------

#### 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 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,976,103.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,904,503.01
减：应计利息总额	7,686.13
减：交易费用	197.80
买卖债券差价收入	63,716.17

#### 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

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	451,680.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	451,680.80

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	1,985,727.20
——股票投资	1,974,319.67
——债券投资	11,407.53
——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	1,985,727.20

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	113,205.33
合计	113,205.33

**6.4.7.18 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
汇划手续费	527.87

合计	15,404.26
----	-----------

#### 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 2023年01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 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	115,185.39	58,281.45
其中：支付销售机构的客户维护费	36,142.63	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X0.60%/当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 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	19,197.57	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X0.10%/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**

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01 日至2023年06 月30日	上年度可比期间 2022年02月28日（基金 合同生效日）至2022年0 6月30日
基金合同生效日（2022年02月28日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	4,213,777.60	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	4,213,777.60	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.97%	0.00%

**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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
南华期货公司	4,258,724.04	5.02%	0.00	0.00%

**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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入



交通银行 股份有限 公司	6,440,719.90	18,067.02	567,623.11	26,506.39
--------------------	--------------	-----------	------------	-----------

注：

- 1.本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按约定利率计息。
- 2.本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2023年6月30日的相关余额在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示。

#### 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（2023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

本基金为混合型基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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，力争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管理委员会，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防控委员会，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管理委员会为核心的、由风险防控委员会、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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，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 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	166,822.70	195,955.16
AAA以下	1,121,404.17	811,387.80
未评级	-	-
合计	1,288,226.87	1,007,342.96

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 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2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 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%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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%。于2023年6月30日，本基金无流动性受限资产。

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。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。

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,440,719.90	-	-	-	6,440,719.90
结算备付金	232,003.22	-	-	2,780.70	234,783.92
存出保证金	22,105.34	-	-	-	22,105.34
交易性金融资产	224,368.73	839,600.11	224,258.03	95,020,816.27	96,309,043.14
买入返售金融	1,157,000.00	-	-	-	1,157,000.00

资产					
应收申购款	-	-	-	2,451,469.77	2,451,469.77
资产总计	8,076,197.19	839,600.11	224,258.03	97,475,066.74	106,615,122.07
负债					
应付清算款	-	-	-	1,124,548.87	1,124,548.87
应付赎回款	-	-	-	37,478.82	37,478.82
应付管理人报酬	-	-	-	36,038.77	36,038.77
应付托管费	-	-	-	6,006.46	6,006.46
应交税费	-	-	-	31.21	31.21
其他负债	-	-	-	207,714.68	207,714.68
负债总计	-	-	-	1,411,818.81	1,411,818.81
利率敏感度缺口	8,076,197.19	839,600.11	224,258.03	96,063,247.93	105,203,303.26
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	903,105.10	-	-	-	903,105.10
结算备付金	4,133.17	-	-	-	4,133.17
存出保证金	3,927.54	-	-	-	3,927.54
交易性金融资产	67,621.52	731,927.93	207,793.51	9,186,979.01	10,194,321.97
应收申购款	-	-	-	1,498.20	1,498.20
资产总计	978,787.33	731,927.93	207,793.51	9,188,477.21	11,106,985.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	43,546.36	43,546.36

回款					
应付管理人报酬	-	-	-	4,881.68	4,881.68
应付托管费	-	-	-	813.60	813.60
应交税费	-	-	-	19.47	19.47
其他负债	-	-	-	151,357.44	151,357.44
负债总计	-	-	-	200,618.55	200,618.55
利率敏感度缺口	978,787.33	731,927.93	207,793.51	8,987,858.66	10,906,367.43

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2023年6月30日，本基金持有的交易性债券投资和公允价值占基金净资产的比例为1.22%，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票、存托凭证投资比例为基金总资产的60-95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2023年06月30日		上年度末 2022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	95,020,816.27	90.32	9,186,979.01	84.24
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,288,226.87	1.22	1,007,342.96	9.24
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	96,309,043.14	91.55	10,194,321.97	93.47

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有误差。

#### 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	4,707,847.82	393,610.80
	业绩比较基准下降5%	-4,707,847.82	-393,610.80

#### 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	96,309,043.14	10,194,321.97
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	96,309,043.14	10,194,321.97

###### 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	95,020,816.27	89.13
	其中：股票	95,020,816.27	89.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,288,226.87	1.21
	其中：债券	1,288,226.87	1.21
	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	1,157,000.00	1.09
	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	6,675,503.82	6.26
8	其他各项资产	2,473,575.11	2.32
9	合计	106,615,122.07	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	3,607,816.00	3.43
B	采矿业	4,633,968.00	4.40
C	制造业	49,792,783.32	47.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,423,293.95	3.25
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,958,715.00	6.61
G	交通运输、仓储和邮政业	6,951,618.00	6.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,389,629.00	3.22
J	金融业	9,259,761.00	8.80
K	房地产业	4,674,953.00	4.44
L	租赁和商务服务业	2,328,279.00	2.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	95,020,816.27	90.32

### 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	002772	众兴菌业	109,900	1,241,870.00	1.18
2	002489	浙江永强	298,700	1,209,735.00	1.15
3	300970	华绿生物	51,700	1,207,712.00	1.15
4	002792	通宇通讯	64,100	1,206,362.00	1.15
5	600250	南纺股份	191,300	1,187,973.00	1.13
6	601975	招商南油	412,100	1,178,606.00	1.12
7	002029	七匹狼	185,400	1,177,290.00	1.12
8	600572	康恩贝	171,600	1,175,460.00	1.12
9	603696	安记食品	124,500	1,175,280.00	1.12
10	603861	白云电器	122,400	1,175,040.00	1.12
11	603697	有友食品	127,900	1,172,843.00	1.11
12	600020	中原高速	319,400	1,172,198.00	1.11
13	600583	海油工程	200,300	1,171,755.00	1.11
14	600858	银座股份	193,900	1,171,156.00	1.11
15	002103	广博股份	195,500	1,171,045.00	1.11
16	002133	广宇集团	345,300	1,170,567.00	1.11
17	605288	凯迪股份	27,170	1,169,396.80	1.11
18	000517	荣安地产	383,300	1,169,065.00	1.11
19	600109	国金证券	134,800	1,168,716.00	1.11
20	600120	浙江东方	305,000	1,168,150.00	1.11
21	002969	嘉美包装	298,700	1,167,917.00	1.11
22	605066	天正电气	124,100	1,167,781.00	1.11
22	600639	浦东金桥	94,100	1,167,781.00	1.11
24	000852	石化机械	162,400	1,167,656.00	1.11
25	002314	南山控股	353,800	1,167,540.00	1.11
26	002423	中粮资本	145,900	1,167,200.00	1.11
27	600883	博闻科技	153,700	1,166,583.00	1.11
28	300839	博汇股份	87,700	1,165,533.00	1.11
29	300908	仲景食品	25,700	1,165,495.00	1.11
30	002131	利欧股份	506,600	1,165,180.00	1.11

31	601555	东吴证券	167,800	1,164,532.00	1.11
32	002038	双鹭药业	115,400	1,164,386.00	1.11
33	003011	海象新材	36,100	1,164,225.00	1.11
34	002424	贵州百灵	129,600	1,163,808.00	1.11
35	605100	华丰股份	66,000	1,163,580.00	1.11
36	601686	友发集团	170,100	1,163,484.00	1.11
37	300943	春晖智控	68,600	1,163,456.00	1.11
38	300164	通源石油	266,200	1,160,632.00	1.10
39	300667	必创科技	58,900	1,159,741.00	1.10
40	600758	辽宁能源	248,300	1,159,561.00	1.10
41	300869	康泰医学	50,482	1,159,066.72	1.10
42	605158	华达新材	152,500	1,159,000.00	1.10
43	002673	西部证券	182,500	1,158,875.00	1.10
44	000735	罗牛山	177,100	1,158,234.00	1.10
45	600830	香溢融通	189,400	1,157,234.00	1.10
46	600516	方大炭素	186,600	1,156,920.00	1.10
47	600897	厦门空港	55,900	1,156,571.00	1.10
48	600351	亚宝药业	162,800	1,155,880.00	1.10
49	688186	广大特材	35,500	1,154,815.00	1.10
50	601086	国芳集团	259,500	1,154,775.00	1.10
51	000783	长江证券	198,900	1,153,620.00	1.10
52	300999	金龙鱼	28,800	1,151,712.00	1.09
53	688626	翔宇医疗	25,300	1,151,403.00	1.09
54	600271	航天信息	84,100	1,151,329.00	1.09
55	300146	汤臣倍健	48,000	1,151,040.00	1.09
56	300783	三只松鼠	58,900	1,150,906.00	1.09
57	605188	国光连锁	133,500	1,150,770.00	1.09
58	600699	均胜电子	65,200	1,150,128.00	1.09
59	600717	天津港	259,500	1,149,585.00	1.09
60	603630	拉芳家化	71,900	1,148,243.00	1.09
61	601816	京沪高铁	218,200	1,147,732.00	1.09

62	601107	四川成渝	281,800	1,146,926.00	1.09
63	688336	三生国健	67,100	1,146,739.00	1.09
64	600635	大众公用	345,300	1,146,396.00	1.09
65	300978	东箭科技	84,100	1,146,283.00	1.09
66	002381	双箭股份	148,300	1,144,876.00	1.09
67	300756	金马游乐	59,840	1,144,140.80	1.09
68	002500	山西证券	204,900	1,143,342.00	1.09
69	603003	龙宇股份	119,700	1,143,135.00	1.09
70	600397	安源煤业	393,800	1,142,020.00	1.09
71	600903	贵州燃气	132,003	1,141,825.95	1.09
72	603331	百达精工	77,100	1,139,538.00	1.08
73	603156	养元饮品	46,100	1,138,670.00	1.08
74	300950	德固特	53,700	1,138,440.00	1.08
75	601601	中国太保	43,700	1,135,326.00	1.08
76	000605	渤海股份	179,600	1,135,072.00	1.08
77	603567	珍宝岛	75,800	1,133,968.00	1.08
78	603121	华培动力	126,600	1,128,006.00	1.07
79	300304	云意电气	202,100	1,119,634.00	1.06
80	300017	网宿科技	157,400	1,119,114.00	1.06
81	002448	中原内配	159,700	1,117,900.00	1.06
82	600728	佳都科技	159,500	1,105,335.00	1.05

## 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	600903	贵州燃气	2,581,363.98	23.67
2	300304	云意电气	2,110,557.00	19.35
3	600250	南纺股份	2,067,617.00	18.96
4	300839	博汇股份	2,020,780.00	18.53

5	601086	国芳集团	1,935,642.00	17.75
6	002103	广博股份	1,884,075.00	17.28
7	601601	中国太保	1,837,439.00	16.85
8	300164	通源石油	1,819,252.00	16.68
9	300017	网宿科技	1,798,572.00	16.49
10	600758	辽宁能源	1,796,233.00	16.47
11	002131	利欧股份	1,701,716.00	15.60
12	600583	海油工程	1,441,576.00	13.22
13	600728	佳都科技	1,399,767.00	12.83
14	603586	金麒麟	1,392,357.00	12.77
15	600271	航天信息	1,380,822.00	12.66
16	603929	亚翔集成	1,302,637.00	11.94
17	600120	浙江东方	1,294,537.00	11.87
18	002423	中粮资本	1,291,714.00	11.84
19	600516	方大炭素	1,284,761.00	11.78
20	300783	三只松鼠	1,277,837.00	11.72
21	300514	友讯达	1,269,824.00	11.64
22	300908	仲景食品	1,263,396.00	11.58
23	603567	珍宝岛	1,262,983.00	11.58
24	000735	罗牛山	1,260,312.81	11.56
25	601686	友发集团	1,258,429.00	11.54
26	300869	康泰医学	1,249,617.58	11.46
27	002489	浙江永强	1,244,520.00	11.41
28	601975	招商南油	1,244,182.00	11.41
29	601555	东吴证券	1,236,872.00	11.34
30	600828	茂业商业	1,235,986.38	11.33
31	002314	南山控股	1,235,298.00	11.33
32	603697	有友食品	1,235,088.40	11.32
33	600639	浦东金桥	1,228,191.00	11.26
34	002424	贵州百灵	1,225,857.17	11.24
35	000517	荣安地产	1,221,906.00	11.20

36	600020	中原高速	1,221,904.00	11.20
37	002133	广宇集团	1,221,566.00	11.20
38	002029	七匹狼	1,221,457.00	11.20
39	600109	国金证券	1,216,341.00	11.15
40	601816	京沪高铁	1,214,138.00	11.13
41	002673	西部证券	1,210,751.00	11.10
42	000783	长江证券	1,208,172.00	11.08
43	601107	四川成渝	1,206,510.00	11.06
44	300943	春晖智控	1,204,556.00	11.04
45	300970	华绿生物	1,199,101.00	10.99
46	002500	山西证券	1,196,895.00	10.97
47	605158	华达新材	1,195,462.00	10.96
48	600717	天津港	1,193,065.00	10.94
49	603156	养元饮品	1,192,626.00	10.94
50	600858	银座股份	1,189,276.00	10.90
51	600883	博闻科技	1,188,194.00	10.89
52	002969	嘉美包装	1,184,425.00	10.86
53	600635	大众公用	1,178,586.00	10.81
54	603696	安记食品	1,177,226.00	10.79
55	600351	亚宝药业	1,169,858.00	10.73
56	000852	石化机械	1,167,472.00	10.70
57	000605	渤海股份	1,164,863.00	10.68
58	300999	金龙鱼	1,163,625.00	10.67
59	600830	香溢融通	1,156,360.00	10.60
60	600572	康恩贝	1,155,070.00	10.59
61	600397	安源煤业	1,150,036.00	10.54
62	603630	拉芳家化	1,149,400.00	10.54
63	600897	厦门空港	1,141,864.00	10.47
64	002038	双鹭药业	1,141,691.00	10.47
65	688336	三生国健	1,141,387.70	10.47
66	300146	汤臣倍健	1,140,642.00	10.46



67	002792	通宇通讯	1,140,435.00	10.46
68	003011	海象新材	1,139,752.00	10.45
69	300756	金马游乐	1,139,260.20	10.45
70	605066	天正电气	1,138,736.00	10.44
71	300950	德固特	1,136,549.00	10.42
72	688186	广大特材	1,133,418.89	10.39
73	603003	龙宇股份	1,133,264.00	10.39
74	300978	东箭科技	1,133,124.00	10.39
75	300232	洲明科技	1,132,140.00	10.38
76	002772	众兴菌业	1,131,643.00	10.38
77	002381	双箭股份	1,131,126.00	10.37
78	605188	国光连锁	1,108,598.00	10.16
79	603861	白云电器	1,094,501.00	10.04
80	688626	翔宇医疗	1,092,499.59	10.02
81	603331	百达精工	1,091,655.00	10.01
82	603121	华培动力	1,091,003.00	10.00
83	300667	必创科技	1,084,918.00	9.95
84	600699	均胜电子	1,082,686.00	9.93
85	300467	迅游科技	1,079,205.00	9.90
86	605100	华丰股份	1,063,449.00	9.75
87	605288	凯迪股份	1,053,379.00	9.66
88	002448	中原内配	1,053,267.00	9.66
89	603711	香飘飘	1,001,514.00	9.18
90	688561	奇安信	977,062.00	8.96
91	600785	新华百货	843,339.00	7.73
92	300434	金石亚药	818,552.00	7.51
93	300830	金现代	756,823.00	6.94
94	003007	直真科技	749,048.00	6.87
95	603768	常青股份	706,625.00	6.48
96	600753	庚星股份	705,922.00	6.47
97	000014	沙河股份	694,763.00	6.37

98	300789	唐源电气	684,857.00	6.28
99	600114	东睦股份	674,259.00	6.18
100	600675	中华企业	663,101.00	6.08
101	002899	英派斯	660,544.00	6.06
102	002082	万邦德	660,270.00	6.05
103	688678	福立旺	659,895.28	6.05
104	600833	第一医药	656,074.00	6.02
105	600665	天地源	653,254.00	5.99
106	688321	微芯生物	652,114.32	5.98
107	002616	长青集团	649,964.00	5.96
108	300407	凯发电气	647,623.00	5.94
109	002669	康达新材	647,093.00	5.93
110	300100	双林股份	645,116.00	5.92
111	600525	长园集团	644,594.00	5.91
112	000680	山推股份	644,340.00	5.91
113	603718	海利生物	643,476.00	5.90
114	603059	倍加洁	643,006.00	5.90
115	002632	道明光学	640,822.00	5.88
116	300462	华铭智能	640,605.00	5.87
117	300888	稳健医疗	635,489.00	5.83
118	300335	迪森股份	633,112.00	5.80
119	002506	协鑫集成	632,787.00	5.80
120	600790	轻纺城	630,977.97	5.79
121	688466	金科环境	630,451.94	5.78
122	600664	哈药股份	626,846.00	5.75
123	600649	城投控股	626,693.00	5.75
124	300900	广联航空	626,584.00	5.75
125	300644	南京聚隆	624,461.00	5.73
126	600279	重庆港	624,357.00	5.72
127	300024	机器人	623,431.00	5.72
128	605177	东亚药业	623,343.00	5.72

129	000897	津滨发展	622,428.00	5.71
130	300863	卡倍亿	618,560.00	5.67
131	000566	海南海药	617,903.00	5.67
132	300425	中建环能	617,033.00	5.66
133	300110	华仁药业	615,304.00	5.64
134	600676	交运股份	614,507.00	5.63
135	300838	浙江力诺	614,310.00	5.63
136	600198	大唐电信	607,730.00	5.57
137	300270	中威电子	605,010.00	5.55
138	300419	浩丰科技	603,767.00	5.54
139	002061	浙江交科	602,258.00	5.52
140	603058	永吉股份	600,941.00	5.51
141	688057	金达莱	600,092.90	5.50
142	600655	豫园股份	599,561.00	5.50
143	300498	温氏股份	596,263.00	5.47
144	600066	宇通客车	591,455.00	5.42
145	300399	天利科技	590,563.00	5.41
146	002093	国脉科技	585,838.00	5.37
147	002611	东方精工	584,690.00	5.36
148	688218	江苏北人	584,487.00	5.36
149	000623	吉林敖东	583,675.60	5.35
150	000036	华联控股	579,760.00	5.32
151	688350	富淼科技	576,267.24	5.28
152	002212	天融信	575,010.00	5.27
153	600822	上海物贸	569,662.00	5.22
154	300882	万胜智能	569,013.00	5.22
155	002111	威海广泰	567,971.00	5.21
156	600827	百联股份	567,799.00	5.21
157	600105	永鼎股份	566,143.00	5.19
158	603199	九华旅游	565,224.00	5.18
159	600539	狮头股份	562,281.00	5.16

160	600683	京投发展	561,586.00	5.15
161	002085	万丰奥威	556,975.00	5.11
162	300080	易成新能	555,998.00	5.10
163	300765	新诺威	555,629.00	5.09
164	300265	通光线缆	553,734.00	5.08
165	600352	浙江龙盛	551,862.00	5.06
166	300602	飞荣达	551,423.00	5.06
167	000681	视觉中国	551,075.00	5.05
168	002892	科力尔	549,859.00	5.04
169	603066	音飞储存	549,279.00	5.04
170	601766	中国中车	542,226.00	4.97
171	603909	建发合诚	539,768.00	4.95
172	002546	新联电子	538,707.00	4.94
173	002752	昇兴股份	537,934.00	4.93
174	600345	长江通信	537,541.00	4.93
175	000758	中色股份	536,271.00	4.92
176	600137	浪莎股份	533,812.00	4.89
177	002012	凯恩股份	531,909.00	4.88
178	300154	瑞凌股份	531,720.00	4.88
179	600517	国网英大	529,936.00	4.86
180	002031	巨轮智能	527,709.00	4.84
181	000006	深振业 A	527,379.00	4.84
182	000570	苏常柴 A	526,056.00	4.82
183	300311	任子行	524,338.00	4.81
184	300230	永利股份	523,735.00	4.80
185	601177	杭齿前进	523,422.00	4.80
186	002628	成都路桥	521,076.00	4.78
187	300066	三川智慧	519,487.00	4.76
188	002322	理工能科	518,912.00	4.76
189	603036	如通股份	518,509.00	4.75
190	603311	金海高科	518,028.00	4.75

191	601956	东贝集团	517,933.00	4.75
192	603326	我乐家居	513,583.00	4.71
193	002910	庄园牧场	511,950.00	4.69
194	300651	金陵体育	509,599.00	4.67
195	300188	美亚柏科	509,480.00	4.67
196	300272	开能健康	507,738.00	4.66
197	603551	奥普家居	504,895.00	4.63
198	600815	厦工股份	501,600.00	4.60
199	000886	海南高速	500,212.00	4.59
200	600008	首创环保	481,290.00	4.41
201	300545	联得装备	445,424.00	4.08
202	688379	华光新材	442,185.90	4.05
203	600251	冠农股份	434,089.00	3.98
204	000011	深物业A	426,890.00	3.91
205	300684	中石科技	403,476.00	3.70
206	300926	博俊科技	378,043.00	3.47
207	002753	永东股份	355,094.00	3.26
208	603699	纽威股份	338,148.00	3.10
209	603089	正裕工业	304,413.00	2.79
210	600548	深高速	289,620.00	2.66
211	300192	科德教育	273,966.00	2.51
212	300516	久之洋	267,888.00	2.46
213	603421	鼎信通讯	258,613.00	2.37
214	603336	宏辉果蔬	255,307.00	2.34
215	000726	鲁泰A	250,917.00	2.30
216	600228	返利科技	249,123.00	2.28
217	300359	全通教育	245,147.00	2.25
218	600756	浪潮软件	245,019.00	2.25

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

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	300514	友讯达	1,684,033.00	15.44
2	603929	亚翔集成	1,537,009.00	14.09
3	603586	金麒麟	1,518,853.00	13.93
4	600903	贵州燃气	1,511,380.50	13.86
5	600828	茂业商业	1,343,215.00	12.32
6	300232	洲明科技	1,261,076.25	11.56
7	300467	迅游科技	1,255,389.00	11.51
8	300304	云意电气	1,131,805.00	10.38
9	603711	香飘飘	1,040,120.00	9.54
10	600250	南纺股份	942,404.00	8.64
11	300434	金石亚药	939,998.00	8.62
12	688561	奇安信	926,576.80	8.50
13	600822	上海物贸	909,694.00	8.34
14	601086	国芳集团	903,777.00	8.29
15	300839	博汇股份	901,711.00	8.27
16	002103	广博股份	890,777.00	8.17
17	300017	网宿科技	871,824.00	7.99
18	600105	永鼎股份	845,689.00	7.75
19	300882	万胜智能	797,612.00	7.31
20	300830	金现代	786,815.00	7.21
21	000014	沙河股份	774,884.00	7.10
22	603768	常青股份	771,947.00	7.08
23	300100	双林股份	761,810.00	6.99
24	600785	新华百货	754,602.00	6.92
25	300188	美亚柏科	737,382.00	6.76
26	300407	凯发电气	736,297.00	6.75
27	600758	辽宁能源	733,248.00	6.72

28	000886	海南高速	732,477.00	6.72
29	603059	倍加洁	717,414.00	6.58
30	600683	京投发展	708,043.00	6.49
31	003007	直真科技	705,218.00	6.47
32	300545	联得装备	703,940.00	6.45
33	600345	长江通信	696,937.00	6.39
34	300789	唐源电气	681,458.00	6.25
35	300164	通源石油	671,242.00	6.15
36	300765	新诺威	668,546.00	6.13
37	600833	第一医药	668,223.00	6.13
38	002061	浙江交科	665,199.00	6.10
39	600665	天地源	662,754.00	6.08
40	300270	中威电子	652,460.00	5.98
41	000566	海南海药	650,780.90	5.97
42	603058	永吉股份	649,447.00	5.95
43	603199	九华旅游	648,525.00	5.95
44	300080	易成新能	644,914.00	5.91
45	688466	金科环境	643,086.21	5.90
46	300024	机器人	639,399.00	5.86
47	002546	新联电子	638,908.00	5.86
48	600664	哈药股份	638,052.00	5.85
49	600525	长园集团	636,758.00	5.84
50	688321	微芯生物	635,465.69	5.83
51	002611	东方精工	635,325.00	5.83
52	000758	中色股份	632,206.00	5.80
53	002899	英派斯	631,421.00	5.79
54	002093	国脉科技	630,483.00	5.78
55	603551	奥普家居	626,635.00	5.75
56	000680	山推股份	626,373.00	5.74
57	600008	首创环保	623,347.00	5.72
58	300498	温氏股份	621,936.00	5.70

59	600649	城投控股	620,134.00	5.69
60	002616	长青集团	619,108.00	5.68
61	600675	中华企业	617,768.00	5.66
62	300399	天利科技	617,421.00	5.66
63	605177	东亚药业	615,867.00	5.65
64	002506	协鑫集成	615,288.00	5.64
65	000570	苏常柴 A	614,959.00	5.64
66	300110	华仁药业	614,705.00	5.64
67	600655	豫园股份	612,713.00	5.62
68	600790	轻纺城	611,458.00	5.61
69	600279	重庆港	610,072.00	5.59
70	300335	迪森股份	608,459.00	5.58
71	603718	海利生物	607,234.00	5.57
72	002131	利欧股份	604,472.00	5.54
73	600066	宇通客车	603,993.00	5.54
74	300602	飞荣达	603,203.00	5.53
75	300154	瑞凌股份	602,295.74	5.52
76	300419	浩丰科技	599,854.00	5.50
77	000681	视觉中国	599,386.00	5.50
78	002085	万丰奥威	596,874.00	5.47
79	300425	中建环能	596,100.00	5.47
80	601601	中国太保	595,368.00	5.46
81	300462	华铭智能	594,188.00	5.45
82	603311	金海高科	593,944.00	5.45
83	000036	华联控股	592,748.00	5.43
84	300888	稳健医疗	589,907.00	5.41
85	300838	浙江力诺	587,413.00	5.39
86	002752	昇兴股份	586,694.00	5.38
87	002082	万邦德	586,241.00	5.38
88	600114	东睦股份	585,605.00	5.37
89	600753	庚星股份	584,165.00	5.36



90	000623	吉林敖东	583,579.00	5.35
91	300272	开能健康	579,905.00	5.32
92	603066	音飞储存	577,473.00	5.29
93	300900	广联航空	576,438.00	5.29
94	300644	南京聚隆	574,189.00	5.26
95	300311	任子行	572,394.00	5.25
96	002012	凯恩股份	572,214.00	5.25
97	600198	大唐电信	570,449.00	5.23
98	002892	科力尔	570,298.00	5.23
99	300651	金陵体育	568,094.00	5.21
100	300230	永利股份	568,087.00	5.21
101	600676	交运股份	567,632.00	5.20
102	600827	百联股份	566,951.00	5.20
103	688057	金达莱	565,518.92	5.19
104	000897	津滨发展	565,329.00	5.18
105	002632	道明光学	564,882.00	5.18
106	600517	国网英大	562,897.00	5.16
107	600137	浪莎股份	549,607.00	5.04
108	601766	中国中车	548,922.00	5.03
109	688218	江苏北人	546,918.65	5.01
110	002212	天融信	546,484.00	5.01
111	300265	通光线缆	546,077.00	5.01
112	002031	巨轮智能	542,885.34	4.98
113	603909	建发合诚	539,606.00	4.95
114	601956	东贝集团	535,049.00	4.91
115	601177	杭齿前进	533,511.00	4.89
116	002669	康达新材	531,781.00	4.88
117	002628	成都路桥	531,680.00	4.87
118	300863	卡倍亿	530,254.52	4.86
119	000006	深振业 A	524,323.00	4.81
120	688350	富淼科技	521,378.42	4.78

121	002910	庄园牧场	519,653.00	4.76
122	600352	浙江龙盛	514,981.00	4.72
123	688678	福立旺	514,755.48	4.72
124	600539	狮头股份	511,745.00	4.69
125	603036	如通股份	510,136.00	4.68
126	002111	威海广泰	502,149.00	4.60
127	300066	三川智慧	496,759.00	4.55
128	603326	我乐家居	490,954.00	4.50
129	002322	理工能科	484,303.00	4.44
130	600815	厦工股份	483,360.00	4.43
131	600228	返利科技	480,965.00	4.41
132	688379	华光新材	454,250.00	4.16
133	300684	中石科技	453,356.00	4.16
134	603089	正裕工业	438,031.00	4.02
135	300516	久之洋	434,105.00	3.98
136	600251	冠农股份	432,077.00	3.96
137	603421	鼎信通讯	425,229.00	3.90
138	603699	纽威股份	423,535.00	3.88
139	000011	深物业A	406,292.05	3.73
140	600548	深高速	399,124.00	3.66
141	300926	博俊科技	392,688.00	3.60
142	603336	宏辉果蔬	373,943.00	3.43
143	000726	鲁泰 A	372,278.00	3.41
144	300192	科德教育	329,303.00	3.02
145	603083	剑桥科技	290,618.00	2.66
146	600895	张江高科	289,022.00	2.65
147	002957	科瑞技术	285,200.00	2.61
148	003011	海象新材	279,742.00	2.56
149	002753	永东股份	275,367.00	2.52
150	300359	全通教育	257,034.00	2.36
151	600756	浪潮软件	252,026.00	2.31

152	688106	金宏气体	251,583.00	2.31
153	000423	东阿阿胶	231,046.00	2.12
154	600728	佳都科技	222,706.00	2.04
155	600583	海油工程	222,017.00	2.04

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	188,530,581.85
卖出股票收入（成交）总额	107,510,347.84

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)	1,288,226.87	1.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,288,226.87	1.22

#### 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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净
---	------	------	-------	------	--------

号					值比例(%)
1	127045	牧原转债	600	70,859.80	0.07
2	110085	通22转债	500	61,560.67	0.06
3	127006	敖东转债	500	61,206.10	0.06
4	128048	张行转债	500	57,200.67	0.05
5	110063	鹰19转债	500	56,608.77	0.05

**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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，山鹰国际控股股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到安徽证监局的处罚。**

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，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	22,105.34
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,451,469.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,473,575.11

#### 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	70,859.80	0.07
2	110085	通22转债	61,560.67	0.06
3	127006	敖东转债	61,206.10	0.06
4	128048	张行转债	57,200.67	0.05
5	110063	鹰19转债	56,608.77	0.05
6	127049	希望转2	55,625.64	0.05
7	113504	艾华转债	50,908.16	0.05
8	111010	立昂转债	49,900.23	0.05
9	127005	长证转债	43,126.63	0.04
10	110080	东湖转债	37,804.60	0.04
11	123149	通裕转债	37,137.62	0.04
12	113535	大业转债	37,044.70	0.04
13	128090	汽模转2	36,840.45	0.04
14	128087	孚日转债	36,751.32	0.03
15	113048	晶科转债	36,390.37	0.03
16	127027	能化转债	36,184.48	0.03

17	113651	松霖转债	36,008.25	0.03
18	123146	中环转2	35,713.09	0.03
19	113632	鹤21转债	35,531.30	0.03
20	118011	银微转债	35,486.21	0.03
21	127040	国泰转债	34,933.42	0.03
22	123100	朗科转债	34,818.37	0.03
23	128066	亚泰转债	34,763.63	0.03
24	123119	康泰转2	34,696.40	0.03
25	113050	南银转债	33,775.36	0.03
26	111009	盛泰转债	33,730.55	0.03
27	113017	吉视转债	32,083.14	0.03
28	113549	白电转债	24,933.92	0.02
29	113524	奇精转债	24,889.02	0.02
30	110064	建工转债	22,581.21	0.02

### 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
3,852	22,030.64	32,013,174.82	37.72%	52,848,868.27	62.28%

### 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	2,671,400.07	3.1479%

### 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	>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
本报告期期初基金份额总额	10,566,771.22
本报告期基金总申购份额	93,196,214.18
减：本报告期基金总赎回份额	18,900,942.31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	84,862,043.09

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

南华基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下南华丰汇混合型证券投资基金于2022年12月12日至2023年1月10日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决时间于2023年1月10日17:00截止，会议期间审议了《关于持续运作南华丰汇混合型证券投资基金的议案》。

本次基金份额持有人大会中，基金份额持有人及其代理人所代表的4,759,781.99份有效基金份额参加了此次持有人大会，且其所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的57.88%（权益登记日为2022年12月9日，权益登记日本基金总份额8,223,477.46份），符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》的有关持有人大会（通讯方式）的召开条件。

参会的基金份额持有人及其代理人所代表的4,759,781.99份基金份额表示同意，0.00份基金份额表示反对，0.00份基金份额表示弃权。经参加投票表决的基金份额持有人所持表决权的100%同意通过议案。同意本次会议议案的基金份额符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，会议议案有效通过。

此次持有人大会的计票于2023年1月11日在本基金的基金托管人交通银行股份有限公司授权代表的监督下，本基金管理人对本次大会进行了计票，上海源泰律师事务所对计票过程进行了监督，北京市方圆公证处对计票过程及结果进行了公证。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。本次基金份额持有人大会于2023年1月11日表决通过了《关于持续运作南华丰汇混合型证券投资基金的议案》，本次大会决议自该日起生效。

本基金的管理人南华基金管理有限公司将自决议表决通过之日起五日内将表决通过的事项报中国证券监督管理委员会备案。

## 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，本基金管理人南华基金管理有限公司的法定代表人于2023年2月28日起由总经理朱坚变更为董事长张哲。前述人事变动已按规定进行备案并公告。

本报告编制期内，本基金管理人南华基金管理有限公司的督察长于2023年8月14日起变更为罗丽娟。前述人事变动已按规定进行备案并公告。

本报告期内，本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，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，本基金的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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人的业务部门及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门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	-	-	-	-	-
招商证券	2	294,822,630.71	100.00%	215,601.06	100.00%	-

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	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	4,938,045.01	100.00%	12,525,000.00	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	南华基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假APP、网站、二维码、公众号诈骗的风险提示	基金管理人网站、公众号	2023-01-05
2	南华基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	基金管理人网站	2023-01-06
3	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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告	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	2023-01-13
4	南华基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金2022年第4季度报告提示性公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、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	2023-01-20
5	南华丰汇混合型证券投资基金基金2022年第4季度报告	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	2023-01-20
6	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增华瑞保险销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-02-08
7	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蚂蚁（杭州）基金销售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	2023-02-13
8	南华丰汇混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-02-15
9	南华丰汇混合型证券投资基金招募说明书（更新）2023年第1号	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-02-15

10	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增洪泰财富（青岛）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	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-03-10
11	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中正达广基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-03-20
12	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中航证券有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-03-22
13	南华基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金2022年年度报告提示性公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、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	2023-03-30
14	南华丰汇混合型证券投资基金基金2022年年度报告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-03-30
15	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增青岛意才基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-03-31
16	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增中山证券有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-04-04
17	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增众惠基金销售有限公司为销售机构并参加	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、	2023-04-04

	其费率优惠的公告	基金管理人网站	
18	南华丰汇混合型证券投资基金基金2023年第1季度报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-04-21
19	南华基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金2023年第1季度报告提示性公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、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	2023-04-21
20	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增平安银行股份有限公司（行E通）为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-05-16
21	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财通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	2023-06-09

## §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	2023/2/2-2023/2/12	2,099,981.43	0.00	0.00	2,099,981.43	2.47%
个人	1	2023/1/1-2023/2/14	2,459,867.20	171,998.32	0.00	2,631,865.52	3.10%
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</p>							

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。

## 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](http://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  
二〇二三年八月三十日