

# 南方策略优化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：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。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。

基金托管人招商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.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46

7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方策略优化混合型证券投资基金
基金简称	南方策略优化混合
基金主代码	202019
前端交易代码	202019
后端交易代码	202020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 3 月 30 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	178,411,517.15 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化手段优化投资策略，在积极把握证券市场及相关行业发展趋势的前提下精选优势个股进行投资，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略包含资产配置、行业配置和个股选择等三个层面。基金管理人在综合分析经济周期、财政政策、市场环境等因素的基础上，采用定量和定性相结合的思路确定本基金的资产配置。针对本基金的行业配置策略，基金管理人开发了基于 Black-Litterman 模型的“南方量化行业配置模型”。在行业配置的基础上，进一步使用“南方多因子量化选股模型”，依据基本面、价值面、市场面和流动性等因素对股票进行综合评分，精选各行业内具有超额收益能力或潜力的优势个股，构建本基金的股票组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

### 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	南方基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95555

传真	0755-82763889	0755-83195201
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518017	518040
法定代表人	周易	缪建民

## 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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,329,505.62
本期利润	6,335,218.13
加权平均基金份额本期利润	0.0353
本期加权平均净值利润率	2.23%
本期基金份额净值增长率	2.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	104,062,723.15
期末可供分配基金份额利润	0.5832
期末基金资产净值	282,474,240.30
期末基金份额净值	1.583
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	61.45%

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

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

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

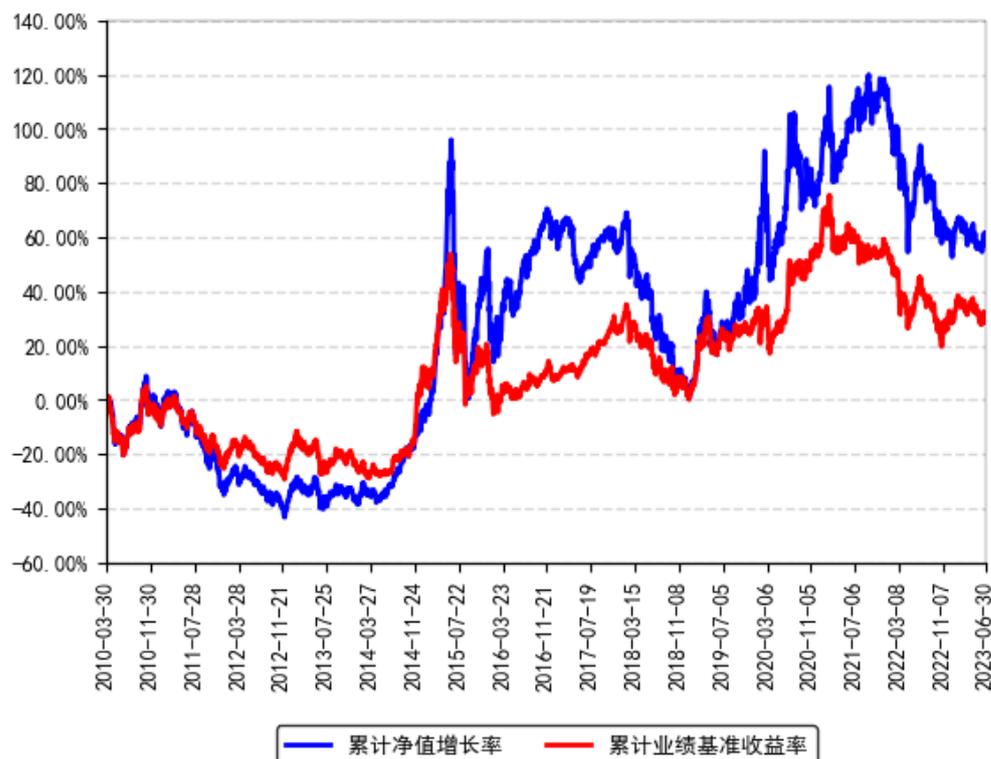
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.79%	0.83%	1.02%	0.70%	1.77%	0.13%
过去三个月	-0.06%	0.79%	-3.84%	0.66%	3.78%	0.13%
过去六个月	2.26%	0.77%	-0.11%	0.67%	2.37%	0.10%
过去一年	-15.08%	0.90%	-10.81%	0.79%	-4.27%	0.11%
过去三年	-12.54%	1.26%	-3.41%	0.96%	-9.13%	0.30%
自基金合同生效起至今	61.45%	1.46%	29.34%	1.12%	32.11%	0.34%

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

南方策略优化混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019年7月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为36172万元人民币。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金 基金经 理	2020 年 12 月 25 日	-	18 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2021 年 3 月 12 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 10 月 22 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证全指医疗保健 ETF 基金经理；2013 年 4 月 22 日至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 17 日至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月 21 日至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月 24 日至今，任南方房地产联接基金经理；2017 年 8 月 25 日至今，任南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 4 月 3 日至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月 8 日至今，任 MSCI 联接基金经理；2020 年 7 月 24 日至今，兼任投资经理；2020 年 12 月 25 日至今，任南方策略基金经理；2021 年 7 月 2 日至今，任南方中证香港科技 ETF (QDII) 基金经理；2022 年 6 月 17 日至今，任南方恒生香港上市生物科技 ETF (QDII) 基金经理；2023 年 5 月 30 日至今，任南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接 (QDII) 基金经理。

朱恒红	本基金基金经理	2020 年 12 月 25 日	- 6 年	北京大学经济学硕士，具有基金从业资格。2016 年 7 月加入南方基金，历任量化投资部助理研究员、指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2020 年 12 月 25 日，任投资经理；2020 年 12 月 25 日至今，任南方策略基金经理；2021 年 4 月 23 日至今，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 7 月 16 日至今，任南方中证香港科技 ETF（QDII）基金经理；2021 年 11 月 2 日至今，任南方中证全指医疗保健 ETF 基金经理；2022 年 6 月 17 日至今，任南方恒生香港上市生物科技 ETF（QDII）基金经理；2022 年 7 月 11 日至今，任南方中证上海环交所碳中和 ETF 基金经理；2022 年 12 月 1 日至今，任南方上证科创板 50 成份增强策略 ETF 基金经理；2023 年 4 月 13 日至今，任南方沪深 300ESG 基准 ETF 基金经理；2023 年 5 月 30 日至今，任南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接（QDII）基金经理；2023 年 6 月 1 日至今，任南方中证上海环交所碳中和 ETF 联接基金经理。
-----	---------	------------------	-------	---

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

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

3、本基金管理人于 2023 年 8 月 26 日发布公告，原基金经理罗文杰女士不再担任本基金基金经理。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	14	67,807,323,128.94	2013 年 04 月 22 日
	私募资产管理计划	8	2,779,034,023.98	2020 年 08 月 07 日
	其他组合	-	-	-
	合计	22	70,586,357,152.92	-

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为13次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年市场在经历1月的快速上涨后，2月以来各大指数陆续开启回调。海外方面，欧美通胀情况仍处于高位，加息预期仍然有变数。国内方面，在一季度积压需求释放后，二季度经济内生动能减弱，叠加出口下行，经济复苏斜率放缓。出于对国内经济基本面的忧虑，市场处于“弱预期弱现实”的定价环境，对于顺周期的博弈，更多放在政策的预期上，而非表观的盈利数据上，因此上半年股价表现与基本面背离的情况明显，情绪整体走弱的背景下市场行情分化轮动加剧，其中TMT及中特估等短期内未见基本面逻辑兑现的方向涨幅反而更大。估值方面，尽管当前多数指数估值水平与去年10月底仍有一定差距，但也都回到了历史低位。

本基金在行业的配置上继续维持基本均衡比例，在风格上超配成长板块。因此在3、4月份AI板块主导的行情中表现一般，未能实现超额收益，但是在5、6月份的震荡行情中，随着AI板块的回落，市场风格开始调整回归，基金表现较好。回顾历史，我们认为行业的

成长性和收益率在长线维度上是匹配的，因此在中长期的维度上，基金仍持续看好成长板块的长期投资价值。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.583 元，报告期内，份额净值增长率为 2.26%，同期业绩基准增长率为-0.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年海外经济韧性偏强，即便加息周期尾声，美债利率也将继续高位震荡。国内复苏在一季度后内生动能修复力度边际趋缓，市场对国际局势、房地产及地方政府债务等内外部风险的担忧有所提升。下半年中国经济增长有望逐步企稳，复苏力度相对温和，流动性将以宽货币、稳信用为主。

行业方面，在增长回稳且流动性尚处宽松的宏观环境下，一方面具备成长空间的新技术领域可能继续受到市场关注，人工智能、新能源、半导体等产业趋势下的科技成长领域仍为当前 A 股稀缺的赛道；另一方面，在消费和部分周期性板块自下而上寻找复苏受益的细分领域可能较为关键。部分主题和高股息资产可能仍有相对收益，但相比上半年需要对业绩兑现和基本面改善领域增加配置权重。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：南方策略优化混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	21,033,575.81	18,439,738.68
结算备付金		1,349,579.18	-
存出保证金		25,729.85	32,191.63
交易性金融资产	6.4.3.2	261,064,747.95	262,313,634.21
其中：股票投资		260,559,151.65	262,313,634.21
基金投资		-	-
债券投资		505,596.30	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
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		158,012.85	214,694.28
应收股利		-	-
应收申购款		51,122.38	163,882.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		283,682,768.02	281,164,140.87
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		164,845.86	123,904.85
应付管理人报酬		342,185.11	358,910.53
应付托管费		57,030.85	59,818.41
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	644,465.90	478,466.25
负债合计		1,208,527.72	1,021,100.04
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	178,411,517.15	180,936,618.33
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	104,062,723.15	99,206,422.50
净资产合计		282,474,240.30	280,143,040.83
负债和净资产总计		283,682,768.02	281,164,140.87

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.583 元，基金份额总额 178,411,517.15 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方策略优化混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		8,897,034.10	-40,840,584.17
1.利息收入		37,750.73	40,381.45
其中：存款利息收入	6.4.3.9	37,750.73	40,381.45
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		186,923.11	-51,789,109.97
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-2,339,230.08	-54,440,515.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	174,068.33	237,287.67
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.12	-	-
股利收益	6.4.3.13	2,352,084.86	2,414,117.68
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的		-	-

收益			
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.14	8,664,723.75	10,893,467.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.15	7,636.51	14,677.18
减：二、营业总支出		2,561,815.97	2,971,076.50
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	2,114,548.41	2,465,245.04
2.托管费	6.4.6.2.2	352,424.74	410,874.16
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
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		0.26	0.35
8.其他费用	6.4.3.16	94,842.56	94,956.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,335,218.13	-43,811,660.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,335,218.13	-43,811,660.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,335,218.13	-43,811,660.67

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方策略优化混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	180,936,618.33	-	99,206,422.50	280,143,040.83
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	180,936,618.33	-	99,206,422.50	280,143,040.83

资产(基金净值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,525,101.18	-	4,856,300.65	2,331,199.47
(一)、综合收益总额	-	-	6,335,218.13	6,335,218.13
(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)	-2,525,101.18	-	-1,478,917.48	-4,004,018.66
其中: 1.基金申购款	9,288,115.87	-	5,392,916.65	14,681,032.52
2.基金赎回款	-11,813,217.05	-	-6,871,834.13	-18,685,051.18
(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)	178,411,517.15	-	104,062,723.15	282,474,240.30
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	181,729,087.96	-	200,954,720.89	382,683,808.85
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)	181,729,087.96	-	200,954,720.89	382,683,808.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	875,324.24	-	-43,236,790.17	-42,361,465.93
(一)、综合收益总额	-	-	-43,811,660.67	-43,811,660.67
(二)、本期基金份额交易产生的	875,324.24	-	574,870.50	1,450,194.74

基金净值变动数 (净值减少以“-” 号填列)				
其中：1.基金申 购款	14,599,070.45	-	11,818,571.71	26,417,642.16
2.基金赎 回款	-13,723,746.21	-	-11,243,701.21	-24,967,447.42
(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)	182,604,412.20	-	157,717,930.72	340,322,342.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	21,033,575.81
等于：本金	21,031,610.51
加：应计利息	1,965.30
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	21,033,575.81

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	264,428,159.11	-	260,559,151.65	-3,869,007.46	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	498,500.00	5,696.30	505,596.30	1,400.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	498,500.00	5,696.30	505,596.30	1,400.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	264,926,659.11	5,696.30	261,064,747.95	-3,867,607.46	

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

**6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.3.5 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.3.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	271.14
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	559,892.20
其中：交易所市场	559,892.20
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
其他	-
合计	644,465.90

**6.4.3.7 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	180,936,618.33	180,936,618.33
本期申购	9,288,115.87	9,288,115.87
本期赎回（以“-”号填列）	-11,813,217.05	-11,813,217.05
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	178,411,517.15	178,411,517.15

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.3.8 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
上年度末	140,829,590.50	-41,623,168.00	99,206,422.50
本期利润	-2,329,505.62	8,664,723.75	6,335,218.13
本期基金份额交易产生的变动数	-1,927,931.09	449,013.61	-1,478,917.48
其中：基金申购款	7,126,782.35	-1,733,865.70	5,392,916.65

基金赎回款	-9,054,713.44	2,182,879.31	-6,871,834.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	136,572,153.79	-32,509,430.64	104,062,723.15

#### 6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	32,356.83
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	5,121.70
其他	272.20
合计	37,750.73

#### 6.4.3.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	499,732,954.05
减：卖出股票成本总额	500,587,218.08
减：交易费用	1,484,966.05
买卖股票差价收入	-2,339,230.08

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

#### 6.4.3.11 债券投资收益

##### 6.4.3.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	2,728.60
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	171,339.73
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	174,068.33

##### 6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	590,440.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	419,000.00
减：应计利息总额	77.14

减：交易费用	23.63
买卖债券差价收入	171,339.73

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

#### 6.4.3.12 衍生工具收益

##### 6.4.3.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 6.4.3.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

#### 6.4.3.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,352,084.86
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,352,084.86

#### 6.4.3.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	8,664,723.75
——股票投资	8,663,323.75
——债券投资	1,400.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	8,664,723.75

#### 6.4.3.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	7,305.62
基金转换费收入	330.89
合计	7,636.51

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费构成，其中不低于转出基金的赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	1,540.00
合计	94,842.56

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

无。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

南方基金管理股份有限公司于 2023 年 7 月 8 日发布公告《南方基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，管理人决定自 2023 年 7 月 10 日起，调低本基金管理费率及托管费率并对基金合同有关条款进行修订。

#### 6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	-	-	2,401.00	0.00%

#### 6.4.6.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	1.14	0.00%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.6.2 关联方报酬

##### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,114,548.41	2,465,245.04
其中：支付销售机构的客户维护费	665,817.79	754,099.82

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
----	------------------------------------	---

当期发生的基金应支付的托管费	352,424.74	410,874.16
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.6.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	21,033,575.81	32,356.83	19,595,235.76	31,980.23

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	113666	爱玛转债	配债	4,190	419,000.00
华泰联合	688472	阿特斯	网下申购	11,546	128,160.60
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	3,170	103,088.40
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	4,577	95,750.84
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	3,317	63,686.40
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券	301322	绿通科技	网下申购	898	117,736.78
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	2,253	72,749.37
兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	网下申购	32,221	183,337.49

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	9,656	217,549.68
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	2,302	186,001.60
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	2,341	133,156.08
兴业证券	600030	中信证券	配股	19,080	275,324.40

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

##### 6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.8 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301486	致尚科技	2023 年 6 月	1 个月内（含）	新股未上市	57.66	57.66	1,753	101,077.98	101,077.98	-

		30 日								
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	39.78	39.78	2,120	84,333.60	84,333.60	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	39.78	39.78	236	9,388.08	9,388.08	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	36.90	36.90	1,776	65,534.40	65,534.40	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	25.82	25.82	2,227	57,501.14	57,501.14	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	25.82	25.82	248	6,403.36	6,403.36	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	19.86	18.06	1,703	33,821.58	30,756.18	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股锁 定期	29.60	71.42	283	8,376.80	20,211.86	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	11.10	17.04	1,155	12,820.50	19,681.20	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	23.60	64.67	273	6,442.80	17,654.91	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	5.69	5.41	3,223	18,338.87	17,436.43	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	23.77	42.89	378	8,985.06	16,212.42	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	76.80	107.95	150	11,520.00	16,192.50	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	37.88	29.49	529	20,038.52	15,600.21	-
301260	格力博	2023	6 个月	新股锁	30.85	23.63	591	18,232.35	13,965.33	-

		年 1 月 20 日		定期						
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	32.52	42.37	317	10,308.84	13,431.29	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	135.8 0	120.4 1	103	13,987.40	12,402.23	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	12.68	22.31	549	6,961.32	12,248.19	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	9.26	18.59	651	6,028.26	12,102.09	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	26.74	40.68	294	7,861.56	11,959.92	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	152.3 8	135.9 7	87	13,257.06	11,829.39	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	23.80	32.84	353	8,401.40	11,592.52	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	10.68	12.34	841	8,981.88	10,377.94	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	75.00	90.76	111	8,325.00	10,074.36	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	36.15	38.13	247	8,929.05	9,418.11	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	14.16	16.21	578	8,184.48	9,369.38	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	43.67	53.05	174	7,598.58	9,230.70	-

688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定期	20.92	19.16	458	9,581.36	8,775.28	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股锁定期	33.73	31.85	270	9,107.10	8,599.50	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股锁定期	30.26	25.33	339	10,258.14	8,586.87	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定期	17.55	16.75	507	8,897.85	8,492.25	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定期	19.20	25.53	332	6,374.40	8,475.96	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股锁定期	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定期	12.10	12.07	681	8,240.10	8,219.67	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股锁定期	50.00	48.39	168	8,400.00	8,129.52	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股锁定期	26.66	31.50	257	6,851.62	8,095.50	-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股锁定期	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股锁定期	72.50	58.42	132	9,570.00	7,711.44	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定期	24.66	22.51	329	8,113.14	7,405.79	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股锁定期	11.88	21.02	346	4,110.48	7,272.92	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股锁定期	46.13	34.40	210	9,687.30	7,224.00	-
301322	绿通科技	2023年2月	6个月	新股锁定期	131.11	53.24	90	11,799.90	4,791.60	-

		27 日								
301322	绿通科技	2023 年 5 月 25 日	1-6 个月(含)	锁定期转增	-	53.24	45	-	2,395.80	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定期	19.99	16.90	421	8,415.79	7,114.90	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁定期	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁定期	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期	25.28	29.87	228	5,763.84	6,810.36	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁定期	39.06	39.36	168	6,562.08	6,612.48	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁定期	56.50	52.93	123	6,949.50	6,510.39	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁定期	125.88	86.79	75	9,441.00	6,509.25	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁定期	33.99	29.49	197	6,696.03	5,809.53	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期	6.58	7.58	742	4,882.36	5,624.36	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定期	73.45	46.64	116	8,520.20	5,410.24	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	11.66	12.26	292	3,404.72	3,579.92	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	10.36	11.84	302	3,128.72	3,575.68	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定期	20.68	25.49	124	2,564.32	3,160.76	-
603125	常青科技	2023	6 个月	新股锁	25.98	24.53	97	2,520.06	2,379.41	-

		年 3 月 30 日		定期						
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	15.38	14.87	157	2,414.66	2,334.59	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定期	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

## 6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

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

## 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

## 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

## 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.9 金融工具风险及管理

## 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金，低于股票基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常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争取将以上风险控制在限定的

范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

#### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.9.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外,如根据基金合同的规定,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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,基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度,按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度,根据质押品的资质确定质押率水平,持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额,并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.9.4 市场风险

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

##### 6.4.9.4.1 利率风险

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

本基金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、存出保证金和应收申购款等。

#### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 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	21,033,575.81	-	-	-	21,033,575.81
结算备付金	1,349,579.18	-	-	-	1,349,579.18
存出保证金	25,729.85	-	-	-	25,729.85
交易性金融资产	505,596.30	-	-	260,559,151.65	261,064,747.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	158,012.85	158,012.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	2,427.00	-	-	48,695.38	51,122.38
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,916,908.14	-	-	260,765,859.88	283,682,768.02
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	164,845.86	164,845.86
应付管理人报酬	-	-	-	342,185.11	342,185.11
应付托管费	-	-	-	57,030.85	57,030.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	644,465.90	644,465.90
负债总计	-	-	-	1,208,527.72	1,208,527.72
利率敏感度缺口	22,916,908.14	-	-	259,557,332.16	282,474,240.30
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	18,439,738.68	-	-	-	18,439,738.68
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	32,191.63	-	-	-	32,191.63
交易性金融资产	-	-	-	262,313,634.21	262,313,634.21
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	214,694.28	214,694.28
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	2,347.00	-	-	161,535.07	163,882.07
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	18,474,277.3	-	-	262,689,863.	281,164,140.

	1			56	87
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融 负债	-	-	-	-	-
衍生金融负 债	-	-	-	-	-
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	123,904.85	123,904.85
应付管理人 报酬	-	-	-	358,910.53	358,910.53
应付托管费	-	-	-	59,818.41	59,818.41
应付销售服 务费	-	-	-	-	-
应付投资顾 问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税 负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	478,466.25	478,466.25
负债总计	-	-	-	1,021,100.04	1,021,100.04
利率敏感度 缺口	18,474,277.3 1	-	-	261,668,763. 52	280,143,040. 83

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-397.92	0.00
2.市场利率平行下降25个基点	399.22	0.00	

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合中，股票(含存托凭证)占基金资产的 60%-95%；债券等固定收益类工具及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5-40%。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。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 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	260,559,151.65	92.24	262,313,634.21	93.64
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	260,559,151.65	92.24	262,313,634.21	93.64

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 上升 5%	9,356,410.14	11,464,252.51
2. 沪深 300 下降 5%	-9,356,410.14	-11,464,252.51	

## 6.4.10 公允价值

### 6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	259,625,831.82
第二层次	906,339.86
第三层次	532,576.27
合计	261,064,747.95

#### 6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 月 30 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	260,559,151.65	91.85
	其中：股票	260,559,151.65	91.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	505,596.30	0.18
	其中：债券	505,596.30	0.18
	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	22,383,154.99	7.89
8	其他资产	234,865.08	0.08
9	合计	283,682,768.02	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,232,481.00	0.79
B	采矿业	-	-
C	制造业	178,899,814.96	63.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,844,305.00	2.78
E	建筑业	8,698,093.92	3.08
F	批发和零售业	6,683,111.37	2.37
G	交通运输、仓储和邮政业	2,921,005.00	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,202,717.12	9.28
J	金融业	2,069,670.00	0.73
K	房地产业	202,948.00	0.07
L	租赁和商务服务业	4,591,093.00	1.63
M	科学研究和技术服务业	14,077,747.42	4.98
N	水利、环境和公共设施管理业	632,093.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	153,090.00	0.05
Q	卫生和社会工作	20,211.86	0.01
R	文化、体育和娱乐业	5,330,770.00	1.89
S	综合	-	-
	合计	260,559,151.65	92.24

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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

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	600519	贵州茅台	5,100	8,624,100.00	3.05
2	300926	博俊科技	321,840	7,350,825.60	2.60
3	603129	春风动力	39,398	6,378,536.20	2.26
4	300811	铂科新材	103,747	6,166,721.68	2.18
5	001269	欧晶科技	81,900	6,022,107.00	2.13
6	002478	常宝股份	771,200	5,745,440.00	2.03
7	300978	东箭科技	419,200	5,713,696.00	2.02
8	300274	阳光电源	48,500	5,656,555.00	2.00
9	605117	德业股份	37,307	5,579,261.85	1.98
10	605167	利柏特	566,878	5,487,379.04	1.94
11	605266	健之佳	65,410	5,483,320.30	1.94
12	300314	戴维医疗	259,200	5,479,488.00	1.94
13	000155	川能动力	366,900	5,283,360.00	1.87
14	300855	图南股份	146,900	5,188,508.00	1.84
15	002371	北方华创	16,300	5,177,695.00	1.83
16	301117	佳缘科技	76,700	4,956,354.00	1.75
17	002967	广电计量	241,100	4,843,699.00	1.71
18	002852	道道全	364,808	4,716,967.44	1.67
19	000858	五粮液	25,800	4,220,106.00	1.49
20	688551	科威尔	62,052	4,069,370.16	1.44
21	000725	京东方 A	983,100	4,020,879.00	1.42
22	600845	宝信软件	78,480	3,987,568.80	1.41
23	301257	普蕊斯	66,500	3,737,300.00	1.32
24	600741	华域汽车	201,900	3,727,074.00	1.32
25	002600	领益智造	533,100	3,683,721.00	1.30
26	002198	嘉应制药	409,000	3,668,730.00	1.30
27	300750	宁德时代	15,500	3,546,245.00	1.26
28	600728	佳都科技	509,400	3,530,142.00	1.25
29	002048	宁波华翔	232,200	3,111,480.00	1.10
30	300272	开能健康	569,800	3,019,940.00	1.07
31	002475	立讯精密	88,300	2,865,335.00	1.01
32	300003	乐普医疗	125,000	2,826,250.00	1.00
33	300124	汇川技术	41,400	2,658,294.00	0.94
34	600039	四川路桥	254,800	2,499,588.00	0.88
35	688777	中控技术	37,713	2,367,622.14	0.84

36	002340	格林美	340,300	2,351,473.00	0.83
37	600760	中航沈飞	49,840	2,242,800.00	0.79
38	601668	中国建筑	381,000	2,186,940.00	0.77
39	601816	京沪高铁	394,000	2,072,440.00	0.73
40	600517	国网英大	363,100	2,069,670.00	0.73
41	002714	牧原股份	48,000	2,023,200.00	0.72
42	601888	中国中免	18,200	2,011,646.00	0.71
43	600309	万华化学	22,700	1,993,968.00	0.71
44	000538	云南白药	35,980	1,888,230.40	0.67
45	000425	徐工机械	278,700	1,886,799.00	0.67
46	688396	华润微	34,133	1,788,910.53	0.63
47	002202	金风科技	165,700	1,759,734.00	0.62
48	000917	电广传媒	235,900	1,724,429.00	0.61
49	002152	广电运通	141,600	1,659,552.00	0.59
50	300127	银河磁体	85,900	1,557,367.00	0.55
51	000157	中联重科	217,900	1,470,825.00	0.52
52	603869	新智认知	128,100	1,455,216.00	0.52
53	600660	福耀玻璃	40,300	1,444,755.00	0.51
54	300999	金龙鱼	35,900	1,435,641.00	0.51
55	600826	兰生股份	139,100	1,428,557.00	0.51
56	600905	三峡能源	263,600	1,415,532.00	0.50
57	600219	南山铝业	452,300	1,365,946.00	0.48
58	002212	天融信	138,000	1,338,600.00	0.47
59	601618	中国中冶	329,100	1,306,527.00	0.46
60	000100	TCL 科技	331,320	1,305,400.80	0.46
61	000997	新大陆	67,505	1,275,844.50	0.45
62	601611	中国核建	150,500	1,271,725.00	0.45
63	000156	华数传媒	144,500	1,257,150.00	0.45
64	300455	航天智装	109,600	1,254,920.00	0.44
65	300144	宋城演艺	100,000	1,240,000.00	0.44
66	000333	美的集团	21,000	1,237,320.00	0.44
67	688100	威胜信息	41,355	1,232,792.55	0.44
68	002027	分众传媒	169,000	1,150,890.00	0.41
69	600104	上汽集团	81,100	1,149,187.00	0.41
70	003816	中国广核	368,300	1,145,413.00	0.41
71	688188	柏楚电子	5,869	1,106,658.64	0.39
72	002739	万达电影	87,800	1,101,012.00	0.39
73	688038	中科通达	72,273	1,081,204.08	0.38
74	601908	京运通	174,100	1,053,305.00	0.37
75	600031	三一重工	55,000	914,650.00	0.32
76	300085	银之杰	76,900	904,344.00	0.32
77	688303	大全能源	22,086	893,378.70	0.32
78	603277	银都股份	40,700	888,888.00	0.31

79	300230	永利股份	247,600	876,504.00	0.31
80	002179	中航光电	19,240	872,534.00	0.31
81	600196	复星医药	28,000	865,200.00	0.31
82	600500	中化国际	149,800	832,888.00	0.29
83	603327	福蓉科技	69,160	821,620.80	0.29
84	600198	大唐电信	119,500	818,575.00	0.29
85	300206	理邦仪器	53,400	805,272.00	0.29
86	601012	隆基绿能	27,600	791,292.00	0.28
87	601098	中南传媒	68,100	789,960.00	0.28
88	600613	神奇制药	112,700	757,344.00	0.27
89	002203	海亮股份	60,700	729,007.00	0.26
90	603659	璞泰来	18,995	725,988.90	0.26
91	600170	上海建工	266,300	716,347.00	0.25
92	600820	隧道股份	118,700	713,387.00	0.25
93	600353	旭光电子	86,800	711,760.00	0.25
94	600276	恒瑞医药	14,300	684,970.00	0.24
95	002402	和而泰	38,600	655,428.00	0.23
96	688299	长阳科技	41,809	655,147.03	0.23
97	002030	达安基因	64,900	647,053.00	0.23
98	600959	江苏有线	191,400	646,932.00	0.23
99	688538	和辉光电	248,597	631,436.38	0.22
100	600436	片仔癀	2,200	629,992.00	0.22
101	002091	江苏国泰	82,700	623,558.00	0.22
102	600893	航发动力	14,600	616,996.00	0.22
103	600567	山鹰国际	265,600	608,224.00	0.22
104	600549	厦门钨业	31,500	599,445.00	0.21
105	002408	齐翔腾达	94,100	599,417.00	0.21
106	300419	浩丰科技	95,200	595,952.00	0.21
107	605259	绿田机械	15,300	593,946.00	0.21
108	600131	国网信通	27,900	563,301.00	0.20
109	002180	纳思达	15,700	537,725.00	0.19
110	600521	华海药业	28,400	522,844.00	0.19
111	002130	沃尔核材	63,400	514,808.00	0.18
112	601238	广汽集团	48,700	507,454.00	0.18
113	600018	上港集团	93,700	491,925.00	0.17
114	000568	泸州老窖	2,300	482,011.00	0.17
115	600111	北方稀土	20,100	481,998.00	0.17
116	002273	水晶光电	40,300	481,182.00	0.17
117	000973	佛塑科技	101,800	454,028.00	0.16
118	601992	金隅集团	208,000	453,440.00	0.16
119	000792	盐湖股份	22,400	429,408.00	0.15
120	600585	海螺水泥	17,800	422,572.00	0.15
121	600177	雅戈尔	64,800	408,888.00	0.14

122	600052	东望时代	90,100	386,529.00	0.14
123	601607	上海医药	17,200	385,452.00	0.14
124	301067	显盈科技	17,640	382,964.40	0.14
125	002887	绿茵生态	41,300	375,417.00	0.13
126	002249	大洋电机	65,600	373,920.00	0.13
127	002001	新和成	23,500	361,900.00	0.13
128	601006	大秦铁路	48,000	356,640.00	0.13
129	600551	时代出版	29,000	320,450.00	0.11
130	600775	南京熊猫	27,800	299,962.00	0.11
131	002414	高德红外	34,710	269,696.70	0.10
132	603890	春秋电子	31,300	267,928.00	0.09
133	000559	万向钱潮	47,000	256,150.00	0.09
134	002266	浙富控股	60,400	249,452.00	0.09
135	300566	激智科技	13,400	247,096.00	0.09
136	300247	融捷健康	72,600	246,840.00	0.09
137	300468	四方精创	23,000	246,330.00	0.09
138	600888	新疆众和	29,900	236,808.00	0.08
139	601019	山东出版	25,700	235,669.00	0.08
140	002498	汉缆股份	55,500	222,555.00	0.08
141	600707	彩虹股份	46,600	221,816.00	0.08
142	300523	辰安科技	8,900	212,354.00	0.08
143	600598	北大荒	15,700	209,281.00	0.07
144	000402	金融街	44,900	202,948.00	0.07
145	603077	和邦生物	72,800	176,904.00	0.06
146	300777	中简科技	3,700	174,862.00	0.06
147	002416	爱施德	23,100	170,478.00	0.06
148	002621	美吉姆	37,800	153,090.00	0.05
149	600637	东方明珠	18,900	147,798.00	0.05
150	688141	杰华特	3,332	130,281.20	0.05
151	301486	致尚科技	1,753	101,077.98	0.04
152	301488	豪恩汽电	2,356	93,721.68	0.03
153	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.03
154	301261	恒工精密	1,776	65,534.40	0.02
155	301202	朗威股份	2,475	63,904.50	0.02
156	688249	晶合集成	1,703	30,756.18	0.01
157	301293	三博脑科	283	20,211.86	0.01
158	688472	阿特斯	1,155	19,681.20	0.01
159	688361	中科飞测	273	17,654.91	0.01
160	688469	中芯集成	3,223	17,436.43	0.01
161	301358	湖南裕能	378	16,212.42	0.01
162	301325	曼恩斯特	150	16,192.50	0.01
163	688443	智翔金泰	529	15,600.21	0.01
164	301260	格力博	591	13,965.33	0.00

165	688478	晶升股份	317	13,431.29	0.00
166	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
167	688576	西山科技	103	12,402.23	0.00
168	688562	航天软件	549	12,248.19	0.00
169	688629	华丰科技	651	12,102.09	0.00
170	688582	芯动联科	294	11,959.92	0.00
171	688531	日联科技	87	11,829.39	0.00
172	301382	蜂助手	353	11,592.52	0.00
173	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
174	688620	安凯微	841	10,377.94	0.00
175	688458	美芯晟	111	10,074.36	0.00
176	688146	中船特气	247	9,418.11	0.00
177	688334	西高院	578	9,369.38	0.00
178	688543	国科军工	174	9,230.70	0.00
179	688512	慧智微	458	8,775.28	0.00
180	301373	凌玮科技	270	8,599.50	0.00
181	688570	天玛智控	339	8,586.87	0.00
182	301355	南王科技	507	8,492.25	0.00
183	688429	时创能源	332	8,475.96	0.00
184	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
185	688352	硕中科技	681	8,219.67	0.00
186	301357	北方长龙	168	8,129.52	0.00
187	688433	华曙高科	257	8,095.50	0.00
188	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
189	301232	飞沃科技	132	7,711.44	0.00
190	301376	致欧科技	329	7,405.79	0.00
191	001287	中电港	346	7,272.92	0.00
192	301203	国泰环保	210	7,224.00	0.00
193	301322	绿通科技	135	7,187.40	0.00
194	301439	泓淋电力	421	7,114.90	0.00
195	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
196	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
197	688631	莱斯信息	228	6,810.36	0.00
198	301323	新莱福	168	6,612.48	0.00
199	301157	华塑科技	123	6,510.39	0.00
200	688623	双元科技	75	6,509.25	0.00
201	688479	友车科技	197	5,809.53	0.00
202	601061	中信金属	742	5,624.36	0.00
203	301345	涛涛车业	116	5,410.24	0.00
204	601133	柏诚股份	292	3,579.92	0.00
205	601065	江盐集团	302	3,575.68	0.00
206	001328	登康口腔	124	3,160.76	0.00
207	603125	常青科技	97	2,379.41	0.00

208	001360	南矿集团	157	2,334.59	0.00
209	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
210	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
211	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

## 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	605117	德业股份	7,934,030.44	2.83
2	002937	兴瑞科技	7,579,783.00	2.71
3	688063	派能科技	7,268,595.31	2.59
4	601699	潞安环能	7,033,570.00	2.51
5	002050	三花智控	6,572,789.00	2.35
6	605266	健之佳	6,357,063.00	2.27
7	300274	阳光电源	6,162,054.82	2.20
8	300820	英杰电气	5,869,686.50	2.10
9	603757	大元泵业	5,857,255.00	2.09
10	600537	亿晶光电	5,690,895.69	2.03
11	688556	高测股份	5,663,695.90	2.02
12	600933	爱柯迪	5,657,802.00	2.02
13	600483	福能股份	5,629,709.00	2.01
14	301268	铭利达	5,584,280.00	1.99
15	688126	沪硅产业	5,583,764.02	1.99
16	002957	科瑞技术	5,553,890.00	1.98
17	301153	中科江南	5,534,175.00	1.98
18	688372	伟测科技	5,490,366.56	1.96
19	688072	拓荆科技	5,459,163.02	1.95
20	300978	东箭科技	5,368,216.00	1.92

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	002594	比亚迪	10,753,860.00	3.84
2	688072	拓荆科技	9,314,878.71	3.33
3	601699	潞安环能	8,987,714.00	3.21
4	603529	爱玛科技	7,739,880.00	2.76
5	301004	嘉益股份	7,702,388.08	2.75

6	300820	英杰电气	7,527,793.00	2.69
7	301153	中科江南	7,468,203.48	2.67
8	300502	新易盛	7,001,826.82	2.50
9	603757	大元泵业	6,888,404.00	2.46
10	603786	科博达	6,267,961.00	2.24
11	688126	沪硅产业	6,145,115.29	2.19
12	002459	晶澳科技	6,086,024.20	2.17
13	300532	今天国际	6,085,115.00	2.17
14	601007	金陵饭店	6,085,033.00	2.17
15	002050	三花智控	5,982,230.00	2.14
16	002085	万丰奥威	5,962,280.00	2.13
17	600284	浦东建设	5,928,362.00	2.12
18	002937	兴瑞科技	5,898,694.00	2.11
19	688372	伟测科技	5,804,826.78	2.07
20	301302	华如科技	5,779,874.09	2.06
21	605108	同庆楼	5,610,370.00	2.00

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	490,169,411.77
卖出股票收入（成交）总额	499,732,954.05

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	505,596.30	0.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	505,596.30	0.18

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019688	22 国债 23	5,000	505,596.30	0.18

## 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

无。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	25,729.85
2	应收清算款	158,012.85
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	51,122.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	234,865.08

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
70,168	2,542.63	5,619,529.20	3.15%	172,791,987.95	96.85%

### 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	216,309.23	0.1212%

### 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	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年3月30日)基金份额总额	2,173,254,149.88
本报告期期初基金份额总额	180,936,618.33
本报告期基金总申购份额	9,288,115.87
减：报告期基金总赎回份额	11,813,217.05
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	178,411,517.15

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	1	475,405,072.06	48.30%	437,997.80	48.31%	-
浙商证券	1	207,094,852.92	21.04%	190,797.35	21.04%	-
东方证券	1	153,365,670.77	15.58%	141,282.23	15.58%	-
银河证券	1	145,218,949.43	14.75%	133,796.20	14.76%	-
财通证券	2	1,417,986.31	0.14%	1,306.43	0.14%	-
长城证券	1	769,534.19	0.08%	708.94	0.08%	-
海通证券	1	415,628.61	0.04%	382.93	0.04%	-
中信建投	2	305,016.73	0.03%	281.03	0.03%	-
华西证券	3	80,471.52	0.01%	74.14	0.01%	-
平安证券	1	110,574.28	0.01%	68.70	0.01%	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
安信证券	2	3,968.00	0.00%	3.66	0.00%	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通	1	16,203.80	0.00%	14.93	0.00%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
金圆统一证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

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

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

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

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

财通证券

摩根大通证券

平安证券

退租交易单元：

无

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东北证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	590,440.50	54.22%	-	-	-	-
银河证券	498,500.00	45.78%	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
金圆统一 证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-25
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-01
3	南方基金关于旗下部分基金增加攀赢基金为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-02
4	南方基金管理股份有限公司关于凤凰金信（海口）基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-13
5	南方基金管理股份有限公司关于凤凰金信（海口）基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-16
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-22
7	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
8	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-15
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资	中国证券报、基金管	2023-04-29

	关联方承销证券的关联交易公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-10
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-03
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
13	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方策略优化混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方策略优化混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方策略优化混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方策略优化混合型证券投资基金 2023 年中期报告》原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>