

# 南方香港优选股票型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§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.....	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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	8
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§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.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	44
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	44
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....	45
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	57
7.8 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.....	57

7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	57
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	57
7.11 投资组合报告附注	57
§8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末上市基金前十名持有人	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.4 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	59
§9 开放式基金份额变动	59
§10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方香港优选股票型证券投资基金
基金简称	南方香港优选股票（QDII-LOF）
场内简称	南方香港 LOF
基金主代码	160125
交易代码	160125
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2015 年 5 月 13 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	213,409,245.42 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所

注：1、本基金转型日期为 2015 年 5 月 13 日，该日起南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）正式变更为南方香港优选股票型证券投资基金。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，积极挖掘香港证券市场上的主题性投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，通过“自上而下”的分析策略对宏观经济中结构性、政策性、周期性以及突发性事件进行研判，挖掘未来经济的发展趋势及背后的驱动因素，预测可能对资本市场产生的重大影响，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出具有持续竞争优势，且估值有吸引力的股票，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获取超额收益。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+人民币同期活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 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	中国农业银行股份有限公司

	公司		
信息披露负责人	姓名	常克川	秦一楠
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	400-889-8899	95599	
传真	0755-82763889	010-68121816	
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京东城区建国门内大街 69 号	
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9	
邮政编码	518017	100031	
法定代表人	周易	谷澍	

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问	境外资产托管人
名称	中文	- 纽约梅隆银行股份有限公司
	英文	- The Bank of New York Mellon Corporation
注册地址		- 225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
办公地址		- 225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
邮政编码		- 10286

## 2.5 信息披露方式

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

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
--------	----------------	------------------

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-150,124,650.93
本期利润	-24,581,818.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0995
本期加权平均净值利润率	-9.10%
本期基金份额净值增长率	-5.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-85,663,897.43
期末可供分配基金份额利润	-0.4014
期末基金资产净值	237,115,170.99
期末基金份额净值	1.1111
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-8.38%

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	6.11%	1.39%	2.73%	1.52%	3.38%	-0.13%
过去三个月	7.23%	1.81%	4.60%	1.75%	2.63%	0.06%
过去六个月	-5.43%	2.32%	-2.04%	1.99%	-3.39%	0.33%
过去一年	-32.73%	2.05%	-20.94%	1.62%	-11.79%	0.43%



过去三年	5.64%	1.54%	-24.12%	1.38%	29.76%	0.16%
自基金合同生效起至今	-8.38%	1.54%	-12.21%	1.23%	3.83%	0.31%

### 3.2.2 自基金转型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

南方香港优选股票（QDII-LOF）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。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司41.16%、深圳市投资控股有限公司27.44%、厦门国际信托有限公司13.72%、兴业证券股份有限公司9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）1.72%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.24%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.25%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.32%。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。

截至本报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 1.69 万亿元，旗下管理 296 只公募基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

#### 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		
熊潇雅	本基金基金经理	2022 年 3 月 4 日	-	6 年	美国伊利诺伊大学厄巴纳香槟分校金融学硕士，具有基金从业资格。2015 年 7 月加入南方基金，历任国际业务部销售经理、研究员。2020 年 6 月 2 日至 2021 年 9 月 29 日，任投资经理助理；2021 年 9 月 29 日至今，任南方香港成长基金经理；2022 年 3 月 4 日至今，任南方香港优选基金经理。
毕凯	本基金基金经理（已离任）	2017 年 8 月 24 日	2022 年 3 月 4 日	9 年	美国埃默里大学工商管理专业（金融方向）硕士，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。曾就职于赛灵思股份有限公司、翰亚投资基金有限公司、晨星资讯有限公司，历任高级分析师、绩效评价员、股票分析师。2015 年 6 月加入南方基金，任职国际业务部研究员；2016 年 12 月 5 日至 2017 年 8 月 24 日，任南方金砖基金经理助理；2017 年 8 月 24 日至 2019 年 4 月 22 日，任国企精明基金经理；2018 年 6 月 8 日至 2021 年 3 月 4 日，任南方沪港深价值基金经理；2017 年 8 月 24 日至 2022 年 3 月 4 日，任南方香港优选基金经理；2020 年 12 月 25 日至 2022 年 3 月 4 日，任南方沪港深优势基金经理。

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

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

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 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2次，是由于投资组合的投资策略需要以及接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年上半年全球市场在各地散发疫情中经历欧美国家高通胀、经济景气度下行，俄乌战争、原材料成本上升等背景及事件，市场呈现明显的波动性特征。2022年1月至2022年6月发达市场 Markit 制造业月度 PMI 分别为 56.4、56.6、56.5、56.3、55.0 和 52.5，保持在荣枯线以上但呈现回落的趋势，其中美国 Markit 制造业月度 PMI 分别为 55.5、57.3、58.8、59.2、57.0 和 52.7；新兴市场 Markit 制造业月度 PMI 分别为 50.0、50.9、49.2、48.1、49.5 和 51.7，呈“U”型走势。从风格上来看，全球价值股指数跑赢成长股指数。按美元计价全收益口径计算，2022年上半年 MSCI 全球价值指数下跌 13.5%，MSCI 全球成长指数下跌 28.3%。

报告期间，MSCI 全球指数按美元计价下跌 20.9%，MSCI 新兴市场指数按美元计价下跌 18.8%，恒生指数按港币计价下跌 6.6%，黄金价格按美元计价下跌 1.2%，十年期美国国债、十年期日本国债及十年期德国国债收益率分别上升 146 个基点、15 个基点和 165 个基

点。新兴市场方面,巴西圣保罗证交所指数按本币计价下跌 6.0%,印度 Nifty 指数按本币计价下跌 9.1%,俄罗斯 MOEX 指数按本币计价下跌 41.8%,美元指数上行,由 95.97 上涨至 104.71。

港股市场方面,2022 年上半年恒生指数下跌 6.57%,恒生国企指数下跌 6.91%。从市值角度来看,恒生大型股指数下跌 8.18%,恒生中型股指数下跌 10.85%,恒生小型股指数下跌 13.93%。根据 Wind 统计,2022 年上半年港股通南下资金累计净买入 1733 亿元人民币,第二季度净流入规模高于第一季度。恒生 AH 股溢价指数于报告期内小幅回落,由 147.00 点下降至 141.89 点。

港股市场上半年经历了多次的逻辑切换,市场板块的轮动速度加快。一季度受到疫情、政策等多方面因素影响,港股在 3 月份经历了市场底部。二季度随着国内重点城市疫情转好逐渐放开,预期经济逐步复苏,消费持续改善,且国家出台针对燃油车的免购置税政策以及各地进一步促进新能源汽车的各项政策有利促进了汽车消费的改善,疫情防控政策方面,密接隔离管控时长以及取消通信行程卡星号等都是进一步推动接触式经济复苏的重要信号,主要的消费品如啤酒、餐饮等品类在 6 月也看到了止跌增长。同时,商品房销售数据看到明显改善,这些因素均促进了市场开始呈现震荡上行的态势。但是 7 月份以来,由于“烂尾楼停贷”事件的发酵使得市场对房地产企业风险以及销售恢复的节奏转向悲观,地产销售对于投资端和消费端增长的影响又直接影响到市场对国内宏观经济恢复的信心;中美关系方面,市场也由于近期相关事件以及中美审计合作谈判陷入僵局而产生两国矛盾的进一步升级的担忧,市场整体的波动幅度加大。海外市场方面,由于美国高通胀,全球流动性收紧,港股还是会受到一定的牵连,后续仍然要密切关注高通胀的有效控制。

#### 4.5.2 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 1.1111 元,报告期内,份额净值增长率为-5.43%,同期业绩基准增长率为-2.04%。

### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,我们仍然维持对港股谨慎乐观的观点,三季度相对谨慎,四季度相对更加乐观。一方面,国内经济整体逐步进入“低基数”阶段,在疫情相对可控的情况下,我们相信中国经济发展的韧性;从监管角度,国内对于平台经济的监管回归正常化,市场情绪已经得到了恢复,等待基本面恢复的过程。当前市场环境下,我们偏好具备估值性价比、业绩稳定且具备防御性的标的,重点关注原材料成本,宏观经济恢复,汽车产业链以及疫情影响等主线下存在机会的行业的公司,比如啤酒、白酒、家电、汽车等,以及中长期维度可选消费、医药和科技的投资机会。

资产配置上,基金在维持行业均衡配置的前提下,整体仓位维持平稳,主要通过自下而上的选股获取超额收益,并通过自上而下的行业研究及宏观研究进行配置决策。在投资策略上以价值投资为导向,遵循自下而上为主的原则,在行业中精选盈利改善、估值水平合理的行业龙头公司,尤其关注公司的技术优势、发展战略、行业成长性以及产业政策的变

化。基金围绕港股市场估值体系重构的长期逻辑进行个股筛选，不断发掘存在估值重估机会的细分行业和个股，同时通过分散化投资控制投资组合整体的风险。本基金在配置过程中也兼顾流动性、市场风格转换及调仓成本等其他相关因素，努力控制基金的回撤水平，力争战胜业绩比较基准，为投资者创造持续稳健的投资回报。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投

资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

# § 6 中期财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：南方香港优选股票型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	33,887,274.77	21,478,261.63
结算备付金		-	-
存出保证金		111,302.98	106,410.64
交易性金融资产	6.4.3.2	199,926,096.81	299,671,332.60
其中：股票投资		199,926,096.81	299,671,332.60
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	6.4.3.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.3.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.3.7	-	-
应收清算款		3,880,557.27	417,079.83
应收股利		1,849,151.02	363,537.66
应收申购款		527,824.27	1,323,481.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.8	-	3,982.64
资产总计		240,182,207.12	323,364,086.07
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		1,645,308.53	766,779.54
应付管理人报酬		300,885.49	446,466.75
应付托管费		56,416.02	83,712.52
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	6.4.3.9	1,064,426.09	1,139,132.72
负债合计		3,067,036.13	2,436,091.53
净资产：			
实收基金	6.4.3.10	213,409,245.42	273,142,418.78
其他综合收益	6.4.3.11	-	-
未分配利润	6.4.3.12	23,705,925.57	47,785,575.76
净资产合计		237,115,170.99	320,927,994.54
负债和净资产总计		240,182,207.12	323,364,086.07

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1111 元，基金份额总额 213,409,245.42 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方香港优选股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-21,898,255.73	60,221,895.36
1.利息收入		23,752.95	119,200.60
其中：存款利息收入	6.4.3.13	23,493.22	115,341.69
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		-	-
其他利息收入		259.73	3,858.91
证券出借利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-149,101,692.06	75,722,726.87
其中：股票投资收益	6.4.3.14	-152,381,512.10	62,492,529.18
基金投资收益	6.4.3.15	-	303,935.58
债券投资收益	6.4.3.16	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.3.18	-	-
衍生工具收益	6.4.3.19	-	4,328,742.02
股利收益	6.4.3.20	3,279,820.04	8,597,520.09
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）	6.4.3.21	125,542,832.11	-15,524,228.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		1,513,809.75	-465,710.95
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.22	123,041.52	369,906.95
减：二、营业总支出		2,683,563.09	8,346,750.47
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	2,163,688.32	3,296,694.79
2.托管费	6.4.6.2.2	405,691.53	618,130.32
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	6.4.3.23	-	-



7.税金及附加		-	19,413.90
8.其他费用	6.4.3.24	114,183.24	4,412,511.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-24,581,818.82	51,875,144.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-24,581,818.82	51,875,144.89
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-24,581,818.82	51,875,144.89

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方香港优选股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	273,142,418.78	-	47,785,575.76	320,927,994.54
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）	273,142,418.78	-	47,785,575.76	320,927,994.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-59,733,173.36	-	-24,079,650.19	-83,812,823.55
（一）、综合收益总额	-	-	-24,581,818.82	-24,581,818.82
（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）	-59,733,173.36	-	502,168.63	-59,231,004.73
其中：1.基金申购款	57,512,213.12	-	6,093,338.92	63,605,552.04
2.基金赎回款	-117,245,386.48	-	-5,591,170.29	-122,836,556.77
（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）	213,409,245.42	-	23,705,925.57	237,115,170.99
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	216,082,270.19	-	83,099,527.08	299,181,797.27
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）	216,082,270.19	-	83,099,527.08	299,181,797.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	62,816,781.25	-	98,683,579.24	161,500,360.49
（一）、综合收益总额	-	-	51,875,144.89	51,875,144.89
（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）	62,816,781.25	-	46,808,434.35	109,625,215.60
其中：1.基金申购款	247,583,166.80	-	156,711,160.03	404,294,326.83
2.基金赎回款	-184,766,385.55	-	-109,902,725.68	-294,669,111.23
（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）	278,899,051.44	-	181,783,106.32	460,682,157.76

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

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下述会计政策外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.1.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产

生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

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

### 6.4.1.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.1.3 收入/（损失）的确认和计量

##### 新金融工具准则

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

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

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

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

## 6.4.2 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

- (a) 金融工具



根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度可比期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、应收利息、应收证券清算款、应收股利和应收申购款，金额分别为 21,478,261.63 元、106,410.64 元、3,982.64 元、417,079.83 元、363,537.66 元和 1,323,481.07 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款、应收股利和应收申购款，金额分别为 21,482,244.27 元、106,410.64 元、0.00 元、417,079.83 元、363,537.66 元和 1,323,481.07 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 299,671,332.60 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 299,671,332.60 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 766,779.54 元、446,466.75 元、83,712.52 元、971,546.40 元和 2,586.32 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 766,779.54 元、446,466.75 元、83,712.52 元、971,546.40 元和 2,586.32 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	33,887,274.77
等于：本金	33,886,783.13
加：应计利息	491.64
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	33,887,274.77

注：货币资金中包括以下外币余额：

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		
	外币金额	汇率	折合人民币
港元	36,944,119.79	0.85519	31,594,241.80
美元	20,038.55	6.7114	134,486.73
合计			31,728,728.53

### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变

					动
股票		185,005,523. 81	-	199,926,096. 81	14,920,573.0 0
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		185,005,523. 81	-	199,926,096. 81	14,920,573.0 0

#### 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。

##### 6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.3.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 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 债权投资

##### 6.4.3.5.1 债权投资情况

无。

##### 6.4.3.6 其他债权投资

##### 6.4.3.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 6.4.3.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

### 6.4.3.7 其他权益工具投资

#### 6.4.3.7.1 其他权益工具投资情况

无。

#### 6.4.3.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

### 6.4.3.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.3.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,099.24
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	971,546.40
其中：交易所市场	971,546.40
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
其他	-
合计	1,064,426.09

### 6.4.3.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	273,142,418.78	273,142,418.78
本期申购	57,512,213.12	57,512,213.12
本期赎回（以“-”号填列）	-117,245,386.48	-117,245,386.48
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	213,409,245.42	213,409,245.42

本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

### 6.4.3.11 其他综合收益

无。

**6.4.3.12 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	43,637,618.50	4,147,957.26	47,785,575.76
本期利润	-150,124,650.93	125,542,832.11	-24,581,818.82
本期基金份额交易产生的变动数	20,823,135.00	-20,320,966.37	502,168.63
其中：基金申购款	-8,104,199.90	14,197,538.82	6,093,338.92
基金赎回款	28,927,334.90	-34,518,505.19	-5,591,170.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-85,663,897.43	109,369,823.00	23,705,925.57

**6.4.3.13 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	23,493.22
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	-
其他	-
合计	23,493.22

**6.4.3.14 股票投资收益****6.4.3.14.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-152,381,512.10
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-152,381,512.10

**6.4.3.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	628,497,687.97
减：卖出股票成本总额	777,955,019.07
减：交易费用	2,924,181.00
买卖股票差价收入	-152,381,512.10

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

**6.4.3.14.3 股票投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

#### 6.4.3.14.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

#### 6.4.3.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

#### 6.4.3.15 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.4.3.16 债券投资收益

##### 6.4.3.16.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.3.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.3.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.3.18 贵金属投资收益

##### 6.4.3.18.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.3.19 衍生工具收益

##### 6.4.3.19.1 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。

##### 6.4.3.19.2 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。

#### 6.4.3.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,279,820.04
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	3,279,820.04

#### 6.4.3.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	125,542,832.11
——股票投资	125,542,832.11
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	125,542,832.11

#### 6.4.3.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	123,041.52
合计	123,041.52

注：本基金场内部分的赎回费率为 0.50%，场外部分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。

#### 6.4.3.23 信用减值损失

无。

#### 6.4.3.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	27,402.79
合计	114,183.24

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

## 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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
纽约梅隆银行股份有限公司(“纽约梅隆银行”)	境外资产托管人
华泰金融控股(香港)有限公司(“华泰香港”)	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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
华泰香港	166,239,242.90	14.09%	397,765,040.02	22.22%
华泰证券	-	-	90,308,486.06	5.05%

#### 6.4.6.1.2 基金交易

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基金交易。

#### 6.4.6.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
华泰香港	199,487.13	15.38%	-	-
华泰证券	-	-	948,676.52	97.65%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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



华泰香港	477,318.11	20.97%	-	-
华泰证券	79,282.93	3.48%	948,676.52	97.65%

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,163,688.32	3,296,694.79
其中：支付销售机构的客户维护费	500,214.82	658,256.26

注：支付基金管理人南方基金管理股份有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.6%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.6\% \div \text{当年天数}$$

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	405,691.53	618,130.32

支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.3%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

##### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
纽约梅隆银行	31,894,473.80	20.87	43,524,788.01	-
中国农业银行	1,992,800.97	23,472.35	11,046,697.71	109,558.86

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司和纽约梅隆银行保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.7 利润分配情况

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.8 期末（2022 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备
1698 HK	博士蛙国际	2012/3/15	已退市	0.14	不适用	不适用	44,000.00	74,335.78	6,246.31	
67 HK	旭光高新	2014/3/25	重大事项	0.01	未知	未知	2,950.00	134,203.06	25.23	
1228 HK	奇峰国际	2014/11/20	已退市	-	不适用	不适用	110,000.00	32,822.22	0.94	
2468 HK	创益太阳能控股有限公司	2012/6/20	已退市	-	不适用	不适用	39,000.00	44,553.93	0.00	
773 HK	中国金属再生资源	2013/1/28	已退市	-	不适用	不适用	50,000.00	291,930.06	0.00	

#### 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

本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

#### 6.4.9.1 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中国农业银行及境外资产托管人纽约梅隆银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内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，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.9.2 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 2022 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(所有者权益)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。

#### 6.4.9.2.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金本报告期末及上年度末无金融资产和金融负债的到期期限分析。

#### 6.4.9.2.2 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期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%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.003%。

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。

#### 6.4.9.3 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。

##### 6.4.9.3.1 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和存出保证金等。

#### 6.4.9.3.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	2,126,584.21	-	-	31,760,690.56	33,887,274.77
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	111,302.98	-	-	-	111,302.98
交易性金融资产	-	-	-	199,926,096.81	199,926,096.81
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	-	-	-	3,880,557.27	3,880,557.27
应收股利	-	-	-	1,849,151.02	1,849,151.02
应收申购款	16,336.69	-	-	511,487.58	527,824.27
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,254,223.88	-	-	237,927,983.24	240,182,207.12
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	-	-	-	1,645,308.53	1,645,308.53
应付管理人报酬	-	-	-	300,885.49	300,885.49
应付托管费	-	-	-	56,416.02	56,416.02
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	-	-	-	1,064,426.09	1,064,426.09
负债总计	-	-	-	3,067,036.13	3,067,036.13
利率敏感度缺口	2,254,223.88	-	-	234,860,947.11	237,115,170.99
上年度末 2021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	9,801,133.99	-	-	11,677,127.64	21,478,261.63
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	106,410.64	-	-	-	106,410.64
交易性金融资产	-	-	-	299,671,332.60	299,671,332.60
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	-	-	-	417,079.83	417,079.83
应收股利	-	-	-	363,537.66	363,537.66

应收申购款	54,015.75	-	-	1,269,465.32	1,323,481.07
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	3,982.64	3,982.64
资产总计	9,961,560.38	-	-	313,402,525.69	323,364,086.07
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	-	-	-	766,779.54	766,779.54
应付管理人报酬	-	-	-	446,466.75	446,466.75
应付托管费	-	-	-	83,712.52	83,712.52
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	-	-	-	1,139,132.72	1,139,132.72
负债总计	-	-	-	2,436,091.53	2,436,091.53
利率敏感度缺口	9,961,560.38	-	-	310,966,434.16	320,927,994.54

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。

#### 6.4.9.3.1.2 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(2022年6月30日)	上年度末(2021年12月31日)
	1.市场利率平行上升25个基点	0.00	0.00
2.市场利率平行下降25个基点	0.00	0.00	



### 6.4.9.3.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.9.3.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
银行存款	134,486.73	31,594,241.80	-	-	-	31,728,728.53
存出保证金	-	111,302.98	-	-	-	111,302.98
交易性金融资产	-	199,926,096.81	-	-	-	199,926,096.81
应收股利	-	1,849,151.02	-	-	-	1,849,151.02
应收证券清算款	-	3,880,557.27	-	-	-	3,880,557.27
资产合计	134,486.73	237,361,349.88	-	-	-	237,495,836.61
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	134,486.73	237,361,349.88	-	-	-	237,495,836.61

项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
应收证券清算款	-	417,079.83	-	-	-	417,079.83
应收股利	-	363,537.66	-	-	-	363,537.66

交易性金融资产	-	299,671,332.60	-	-	-	299,671,332.60
存出保证金	-	106,410.64	-	-	-	106,410.64
银行存款	38,105.01	11,504,560.86	-	-	-	11,542,665.87
资产合计	38,105.01	312,062,921.59	-	-	-	312,101,026.60
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	38,105.01	312,062,921.59	-	-	-	312,101,026.60

#### 6.4.9.3.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	11,873,170.09	15,605,051.33
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-11,873,170.09	-15,605,051.33	

#### 6.4.9.3.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票（普通股、优先股）的基金资产占基金资产总值的比例为 80%-95%；其余基金资产投资于存托凭证、房地产信托凭证、公募基金、金融衍生产品、结构性投资产品、货币市场工具、其它固定收益产品以及相关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具，其占基金资产总值的

比例为 5%-20%。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。

#### 6.4.9.3.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	199,926,096.81	84.32	299,671,332.60	93.38
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	199,926,096.81	84.32	299,671,332.60	93.38

#### 6.4.9.3.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	12,694,312.83	14,300,159.48
2.组合自身基准下降 5%	-12,694,312.83	-14,300,159.48	

### 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

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
---------------	---------------------

第一层次	199,919,824.33
第二层次	6,272.48
第三层次	0.00
合计	199,926,096.81

#### 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；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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。

#### 6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 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

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	199,926,096.81	83.24
	其中：普通股	199,926,096.81	83.24
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付 金合计	33,887,274.77	14.11
8	其他资产	6,368,835.54	2.65
9	合计	240,182,207.12	100.00

无。

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	199,926,096.81	84.32
合计	199,926,096.81	84.32

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	9,657,989.06	4.07
材料	14,281,887.31	6.02
工业	1,216,422.26	0.51
非必需消费品	38,725,276.28	16.33
必需消费品	15,601,463.82	6.58
医疗保健	23,456,841.04	9.89
金融	24,947,166.53	10.52
科技	-	-
通讯	31,257,852.99	13.18
公用事业	6,040,822.71	2.55
房地产	34,740,374.81	14.65
政府	-	-
合计	199,926,096.81	84.32

本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

### 7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	China Oversea	中海物业集团	2669 HK	中国香港联合	中国香港	1,673,000	12,089,692.75	5.10

	s Property Holdings Limited	有限公司		交易所				
2	C&D International Investment Group Limited	建发国际投资集团有限公司	1908 HK	中国香港联合交易所	中国香港	619,000	11,222,487.33	4.73
3	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	中银香港(控股)有限公司	2388 HK	中国香港联合交易所	中国香港	399,500	10,591,100.56	4.47
4	Kuaishou Technology	快手科技	1024 HK	中国香港联合交易所	中国香港	132,000	9,866,155.99	4.16
5	Meituan	美团	3690 HK	中国香港联合交易所	中国香港	58,200	9,665,733.66	4.08
6	China Mobile Limited	中国移动有限公司	0941 HK	中国香港联合交易所	中国香港	178,100	7,463,157.61	3.15
7	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	香港交易及结算有限公司	0388 HK	中国香港联合交易所	中国香港	21,600	7,130,232.14	3.01
8	CGN Mining Company Limited	中广核矿业集团有限公司	1164 HK	中国香港联合交易所	中国香港	11,110,000	6,935,847.46	2.93
9	Wuxi Apptec Co.,Ltd.	无锡药明康德新药开发股份	2359 HK	中国香港联合交易所	中国香港	77,000	6,881,286.34	2.90

		有限公司						
10	Greentown China Holdings Limited	绿城中国控股有限公司	3900 HK	中国香港联合交易所	中国香港	459,000	6,382,573.73	2.69
11	ENN Energy Holdings Limited	新奥能源控股有限公司	2688 HK	中国香港联合交易所	中国香港	54,800	6,040,822.71	2.55
12	JD.com, Inc.	京东集团股份有限公司	9618 HK	中国香港联合交易所	中国香港	27,500	5,945,280.88	2.51
13	Zhaojin Mining Industry Company Limited	招金矿业股份有限公司	1818 HK	中国香港联合交易所	中国香港	972,000	5,702,338.50	2.40
14	Man Wah Holdings Limited	敏华控股有限公司	1999 HK	中国香港联合交易所	中国香港	750,300	5,441,184.00	2.29
15	Tsingtao Brewery Company Limited	青岛啤酒股份有限公司	0168 HK	中国香港联合交易所	中国香港	77,600	5,415,199.91	2.28
16	China Resources Beer (Holdings) Company Limited	华润啤酒(控股)有限公司	0291 HK	中国香港联合交易所	中国香港	107,400	5,373,073.25	2.27
17	Hygeia Healthc	海吉亚医疗控	6078 HK	中国香港联合	中国香港	115,800	5,164,466.75	2.18

	are Holding s Co., Limited	股有限公司		交易所				
18	CIFI Ever Sunshine Services Group Limited	旭辉永升服务集团有限公司	1995 HK	中国香港联合交易所	中国香港	590,000	5,045,621.00	2.13
19	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co., Ltd	新疆金风科技股份有限公司	2208 HK	中国香港联合交易所	中国香港	398,800	5,006,610.65	2.11
20	Industrial and Commercial Bank of China Limited	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,187,500	4,732,407.66	2.00
21	Cnooc Limited	中国海洋石油有限公司	0883 HK	中国香港联合交易所	中国香港	525,000	4,651,378.41	1.96
22	Li Ning Co. Ltd.	李宁有限公司	2331 HK	中国香港联合交易所	中国香港	65,500	4,072,286.50	1.72
23	Innovent Biologics, Inc.	信达生物制药	1801 HK	中国香港联合交易所	中国香港	132,000	3,939,689.29	1.66
24	Fuyao Glass Industry Group Co., Ltd.	福耀玻璃工业集团股份有限公司	3606 HK	中国香港联合交易所	中国香港	115,200	3,921,011.94	1.65
25	Haier	海尔智	6690	中国香	中国香	145,000	3,602,2	1.52



	Smart Home Co., Ltd.	家股份有限公司	HK	港联合交易所	港		74.08	
26	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	中国蒙牛乳业有限公司	2319 HK	中国香港联合交易所	中国香港	101,727	3,405,890.00	1.44
27	Xtep International Holdings Limited	特步国际控股有限公司	1368 HK	中国香港联合交易所	中国香港	275,300	3,343,160.06	1.41
28	XPeng Inc.	小鹏汽车有限公司	9868 HK	中国香港联合交易所	中国香港	29,500	3,188,832.47	1.34
29	Great Wall Motor Company Limited	长城汽车股份有限公司	2333 HK	中国香港联合交易所	中国香港	188,500	2,601,821.50	1.10
30	Postal Savings Bank of China Co.,Ltd.	中国邮政储蓄银行股份有限公司	1658 HK	中国香港联合交易所	中国香港	468,000	2,493,426.17	1.05
31	CSPC Pharmaceutical Group Limited	石药集团有限公司	1093 HK	中国香港联合交易所	中国香港	374,000	2,491,561.86	1.05
32	Pharmaron Beijing Co., Ltd.	康龙化成(北京)新药技术股份有限公司	3759 HK	中国香港联合交易所	中国香港	34,950	2,347,772.35	0.99
33	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	0700 HK	中国香港联合交易所	中国香港	7,600	2,303,402.95	0.97
34	NetEase	网易公	9999	中国香	中国香	15,900	1,959,4	0.83

	, Inc	司	HK	港联合交易所	港		02.78	
35	Zijin Mining Group Company Limited	紫金矿业集团股份有限公司	2899 HK	中国香港联合交易所	中国香港	200,000	1,643,675.18	0.69
36	Helens International Holdings Company Limited	海伦司国际控股有限公司	9869 HK	中国香港联合交易所	中国香港	100,000	1,547,893.90	0.65
37	Bosideng International Holdings Ltd.	波司登国际控股有限公司	3998 HK	中国香港联合交易所	中国香港	342,000	1,424,353.15	0.60
38	Smoores International Holdings Limited	思摩尔国际控股有限公司	6969 HK	中国香港联合交易所	中国香港	68,000	1,407,300.66	0.59
39	Gushengtang Holdings Limited	固生堂控股有限公司	2273 HK	中国香港联合交易所	中国香港	41,000	1,367,448.81	0.58
40	Jiumaoyu International Holdings Limited	九毛九国际控股有限公司	9922 HK	中国香港联合交易所	中国香港	72,000	1,283,811.23	0.54
41	ZTO Express (Cayman)	中通快递(开曼)有限	2057 HK	中国香港联合交易所	中国香港	7,000	1,216,422.26	0.51

	n) Inc.	公司						
42	China Yongda Automobiles Services Holdings Limited	中国永达汽车服务控股有限公司	3669 HK	中国香港联合交易所	中国香港	188,000	1,192,955.84	0.50
43	ANTA Sports Products Limited	安踏体育用品有限公司	2020 HK	中国香港联合交易所	中国香港	14,000	1,154,164.42	0.49
44	Carsgen Therapeutics Holdings Limited	科济药业控股有限公司	2171 HK	中国香港联合交易所	中国香港	51,000	637,646.77	0.27
45	New Horizon Health Limited	诺辉健康	6606 HK	中国香港联合交易所	中国香港	31,065	626,968.87	0.26
46	Boshiwa International Holding Ltd	博士蛙国际	1698 HK	中国香港联合交易所	中国香港	44,000	6,246.31	0.00
47	China Lumena New Materials Corp.	中国旭光高新材料集团有限公司	0067 HK	中国香港联合交易所	中国香港	2,950	25.23	0.00
48	Superb Summit International Group Limited	奇峰国际集团有限公司	1228 HK	中国香港联合交易所	中国香港	110,000	0.94	0.00
49	Trony Solar	创益太阳能	2468 HK	中国香港联合交易所	中国香港	39,000	0.00	0.00

	Holding s Co Ltd			交易所				
50	China Metal Recycli ng Holdi ngs Ltd	中国金 属再生 资源	0773 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	50,000	0.00	0.00

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	1995 HK	24,043,491.58	7.49
2	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2388 HK	18,707,126.57	5.83
3	CHINA MOBILE LTD	941 HK	15,172,307.25	4.73
4	CNOOC LTD	883 HK	13,713,397.65	4.27
5	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	13,625,635.42	4.25
6	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	2669 HK	13,509,711.31	4.21
7	CHINA CONSTRUCTIO N BANK-H	939 HK	13,499,292.59	4.21
8	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	6098 HK	13,082,174.69	4.08
9	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	968 HK	12,743,949.68	3.97

10	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	12,709,027.26	3.96
11	POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	1658 HK	12,478,620.81	3.89
12	CHINA YONGDA AUTOMOBILES SER	3669 HK	12,474,734.45	3.89
13	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3606 HK	12,358,380.05	3.85
14	WUXI APPTec CO LTD-H	2359 HK	12,230,910.97	3.81
15	IND & COMM BK OF CHINA-H	1398 HK	12,159,295.69	3.79
16	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL-H	3908 HK	11,777,407.00	3.67
17	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	11,550,245.40	3.60
18	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	960 HK	11,375,235.40	3.54
19	MEITUAN-CLASS B	3690 HK	11,185,356.62	3.49
20	JD.COM INC - CLASS A	9618 HK	10,519,496.02	3.28
21	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	2688 HK	10,062,922.63	3.14
22	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	1908 HK	10,043,002.84	3.13
23	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	168 HK	9,446,207.87	2.94

24	CGN MINING CO LTD	1164 HK	9,302,710.77	2.90
25	CHINA MENGNIU DAIRY CO	2319 HK	8,497,296.34	2.65
26	POP MART INTERNATION AL GROUP	9992 HK	8,295,893.11	2.59
27	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	291 HK	8,098,168.37	2.52
28	CHINA MERCHANTS BANK-H	3968 HK	7,814,557.26	2.44
29	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	836 HK	7,753,852.79	2.42
30	AIA GROUP LTD	1299 HK	7,654,440.84	2.39
31	MMG LTD	1208 HK	7,522,947.28	2.34
32	MAN WAH HOLDINGS LTD	1999 HK	7,299,978.94	2.27
33	KUAISHOU TECHNOLOGY	1024 HK	7,237,714.37	2.26
34	LI NING CO LTD	2331 HK	7,070,282.36	2.20
35	WH GROUP LTD	288 HK	6,971,026.00	2.17
36	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	6,602,858.30	2.06
37	HELENS INTERNATION AL HOLDING	9869 HK	6,584,522.49	2.05
38	HUAZHU GROUP LTD	1179 HK	6,551,430.30	2.04

1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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。

## 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	KUAISHOU TECHNOLOGY	1024 HK	27,854,022.42	8.68
2	SANDS CHINA LTD	1928 HK	21,349,854.90	6.65
3	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	27 HK	19,306,160.67	6.02
4	CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	1995 HK	18,555,041.29	5.78
5	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	6098 HK	18,255,223.99	5.69
6	SHENZHEN INTL HOLDINGS	152 HK	18,124,735.43	5.65
7	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIALS HOLDING LTD	3323 HK	17,635,451.32	5.50
8	SHANDONG CHENMING PAPER-H	1812 HK	14,861,041.62	4.63
9	SJM HOLDINGS LTD	880 HK	14,644,093.05	4.56
10	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	14,564,719.48	4.54
11	MMG LTD	1208 HK	14,473,354.29	4.51
12	SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	873 HK	14,125,299.14	4.40
13	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	13,797,524.35	4.30
14	XINYI SOLAR	968 HK	12,804,106.23	3.99

	HOLDINGS LTD			
15	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	2128 HK	12,537,961.92	3.91
16	EXCELLENCE COMMERCIAL PROPER	6989 HK	12,522,855.66	3.90
17	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	11,655,619.56	3.63
18	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	1951 HK	11,532,237.42	3.59
19	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	868 HK	11,240,688.19	3.50
20	CATHAY MEDIA AND EDUCATION	1981 HK	10,860,572.95	3.38
21	JINKE SMART SERVICES GROUP-H	9666 HK	10,735,329.95	3.35
22	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	10,496,320.18	3.27
23	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	960 HK	10,329,408.00	3.22
24	POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	1658 HK	9,879,812.55	3.08
25	CHINA YONGDA AUTOMOBILE S SER	3669 HK	9,659,611.45	3.01
26	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL-H	3908 HK	9,404,150.13	2.93
27	NINE DRAGONS PAPER	2689 HK	8,866,146.81	2.76



	HOLDINGS			
28	CNOOC LTD	883 HK	8,864,867.63	2.76
29	POP MART INTERNATION AL GROUP	9992 HK	8,764,172.07	2.73
30	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2388 HK	8,522,964.84	2.66
31	CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	6169 HK	8,279,380.06	2.58
32	AIA GROUP LTD	1299 HK	7,917,531.91	2.47
33	IND & COMM BK OF CHINA- H	1398 HK	7,725,316.12	2.41
34	WH GROUP LTD	288 HK	7,544,212.27	2.35
35	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	836 HK	6,989,997.91	2.18
36	CHINA MERCHANTS BANK-H	3968 HK	6,987,217.57	2.18
37	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3606 HK	6,820,885.25	2.13
38	WUXI APTEC CO LTD-H	2359 HK	6,727,875.99	2.10
39	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	6,523,801.01	2.03

1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	552,666,951.16
卖出收入（成交）总额	628,497,687.97

注：买入成本和卖出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。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.8 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。

## 7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，美团在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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	111,302.98
2	应收清算款	3,880,557.27
3	应收股利	1,849,151.02
4	应收利息	-
5	应收申购款	527,824.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,368,835.54

#### 7.11.4 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债券。

#### 7.11.5 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
38,283	5,574.52	4,005,216.93	1.88%	209,404,028.49	98.12%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	韩如冰	851,400.00	7.02%
2	孙慧榕	850,000.00	7.01%
3	左群	545,634.00	4.50%
4	罗远芬	380,000.00	3.13%
5	杨凯	328,231.00	2.71%
6	唐亮	260,400.00	2.15%
7	王安民	240,000.00	1.98%
8	李元生	234,455.00	1.93%

9	王剑鹏	228,927.00	1.89%
10	黄锦永	200,000.00	1.65%

### 8.3 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	2,253,256.48	1.0558%

### 8.4 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

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年5月13日)基金份额总额	2,292,367,534.76
本报告期期初基金份额总额	273,142,418.78
本报告期基金总申购份额	57,512,213.12
减：报告期基金总赎回份额	117,245,386.48
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	213,409,245.42

## § 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

2022年5月27日，周易先生任南方基金管理股份有限公司董事长（法定代表人）。

2022年3月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022年3月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 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，基金管理人收到中国证券监督管理委员会深圳监管局对公司的监管措施。基金管理人已及时按要求改正并报告。

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	
GuangFa Securities (Hong Kong) Business Limited	-	182,711,020.86	15.48%	215,311.17	16.60%	-
Haitong International Securities Co.,Ltd	-	180,136,323.94	15.26%	180,524.20	13.92%	-
China International Capital Corporation Hong Kong	-	173,234,461.09	14.68%	207,881.37	16.03%	-

Securities Limited						
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	166,239,242.90	14.09%	199,487.13	15.38%	-
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	137,031,329.02	11.61%	137,031.35	10.57%	-
UBS Securities Asia Limited	-	100,055,746.04	8.48%	100,055.74	7.71%	-
China Renaissance Securities (HK) Limited	-	74,764,981.79	6.33%	74,764.97	5.76%	-
BOCI Securities Limited	-	59,833,807.74	5.07%	59,833.80	4.61%	-
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	-	51,141,598.35	4.33%	51,141.62	3.94%	-
CLSA Limited	-	38,838,243.41	3.29%	46,605.88	3.59%	-
Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	16,256,413.11	1.38%	24,384.62	1.88%	-

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

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；

2、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;

3、公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;

4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

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

1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确;

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C: 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

新增交易单元:

无

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

无。

### 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	关于南方香港优选股票型证券投资基金 2022 年境外主要市场节假日申购赎回安排的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-05
2	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金申购费率优惠标准的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-18
3	关于南方香港优选股票型证券投资基金变更基金经理的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-05
4	关于南方香港优选股票型证券投资基金 2022 年 4 月 15 日、4 月 18 日暂停申购、赎回和定投业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-12
5	关于南方香港优选股票型证券投资基金 2022 年 5 月 9 日暂停申购、赎回和定投业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-29
6	关于南方香港优选股票型证券投资基金 2022	上海证券报、基金管	2022-06-28

	年 7 月 1 日暂停申购、赎回和定投业务的公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
--	--------------------------	--------------------	--

## § 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					报告期末持有基金份额
	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	
机构	1	20220309-20220309	47,858,788.22	-	47,858,788.22	

#### 产品特有风险

本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以有时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

### 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香港优选股票型证券投资基金的文件；
- 2、《南方香港优选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方香港优选股票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、《南方香港优选股票型证券投资基金 2022 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>