

# 南方科创板 3 年定期开放混合型证券 投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 09 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：2021 年 10 月 27 日

## § 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。

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2021年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	南方科创板3年定开混合
场内简称	科创板基
基金主代码	506000
交易代码	506000
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年7月28日
报告期末基金份额总额	2,967,030,550.52份
投资目标	本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化行业深度研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>(一) 封闭期投资策略</p> <p>1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；</p> <p>4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、股票期权投资策略；8、转融通证券出借业务投资策略；</p> <p>(二) 开放期投资策略</p> <p>本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p>

业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率*65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+中债总指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金可投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。
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

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“科创板基”。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年7月1日—2021年9月30日）
1.本期已实现收益	419,960,280.43
2.本期利润	-19,836,740.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0067
4.期末基金资产净值	3,478,263,570.91
5.期末基金份额净值	1.1723

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

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。

#### 3.2 基金净值表现

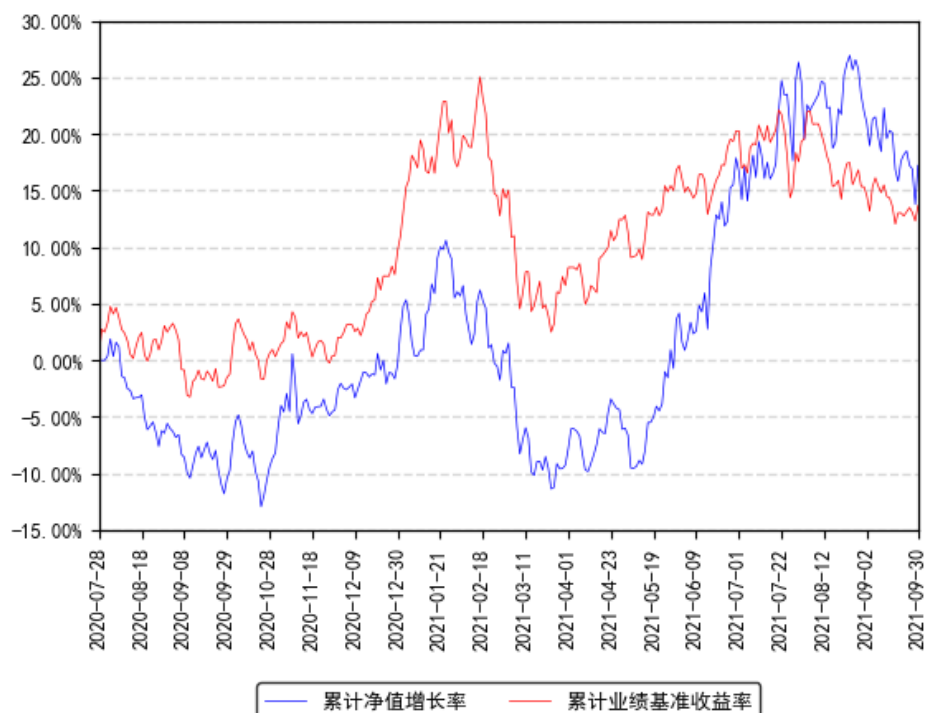
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-0.57%	1.91%	-5.50%	1.12%	4.93%	0.79%
过去六个月	29.21%	1.78%	6.63%	1.07%	22.58%	0.71%
过去一年	29.89%	1.69%	15.10%	1.21%	14.79%	0.48%

自基金合同生效起至今	17.23%	1.60%	13.67%	1.17%	3.56%	0.43%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	-------

### 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

南方科创板3年定开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



注：本基金建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
茅炜	本基金基金经理	2020年7月28日	-	13年	上海财经大学保险学学士，具有基金从业资格。曾任职于东方人寿保险公司及生命人寿保险公司，担任保险精算员，在国金证券研究所任职期间，担任保险及金融行业研究员。2009年加入南方基金，历任研究部保险及金融行业研究员、研究部总监助理、副总监、执行总监、总监、权益研究部总经理，现任权益投资部总经理、董事总经理、境内权

				<p>益投资决策委员会委员；2012年10月12日至2016年1月26日，兼任专户投资管理部投资经理；2018年2月2日至2020年2月7日，任南方教育股票基金经理；2018年6月8日至2020年4月10日，任南方医保基金经理；2016年2月3日至2020年5月15日，任南方君选基金经理；2019年12月6日至2020年11月17日，任南方消费基金经理；2019年3月29日至2020年11月20日，任南方军工混合基金经理；2020年2月7日至2021年6月18日，任南方高端装备基金经理；2020年11月17日至2021年6月18日，任南方消费基金经理；2019年12月20日至2021年8月3日，任南方配售基金经理；2018年5月30日至今，任南方君信混合基金经理；2019年5月6日至今，任南方科技创新混合基金经理；2019年6月19日至今，任南方信息创新混合基金经理；2020年6月12日至今，任南方成长先锋混合基金经理；2020年7月28日至今，任科创板基金基金经理；2020年8月4日至今，任南方景气驱动混合基金经理；2021年8月3日至今，任南方优势产业混合基金经理；2021年9月7日至今，任南方均衡优选一年持有期混合基金经理。</p>	
王博	本基金基金经理	2020年7月28日	-	6年	<p>清华大学工学硕士，具有基金从业资格。2015年7月加入南方基金，任权益研究部行业研究员，现任TMT研究组组长。2018年9月25日至2019年11月11日，任南方瑞合基金经理助理；2019年11月11日至今，任南方科技创新混合基金经理；2020年6月12日至今，任南方成长先锋混合基金经理；2020年7月28日至今，任科创板基金基金经理。</p>

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定；

3、本基金管理人于2021年10月16日发布公告，原基金经理茅炜先生不再担任本基金基金经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和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 公平交易专项说明

### 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。

### 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，未出现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%的情况。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年三季度A股市场呈现震荡走势，体现为基本面驱动的特征，风格整体上偏向成长，以新能源为代表的新兴成长行业表现较好，市场对个股的长期成长逻辑和中期业绩将更加看重。本基金在报告期内，坚持在新兴成长行业中选取优质成长公司，以公司质地、成长性、合理估值作为主要选股标准，我们对安全边际不足的个股保持谨慎态度，选股和配置难度会增加。本产品在投资策略和运作方面，坚持从长期价值和产业趋势出发，将更加坚定持有能够抵御经济周期波动的龙头公司，以更长的视角去进行投资的判断与决策。

## 4.5 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1.1723元，报告期内，份额净值增长率为-0.57%，同期业绩基准增长率为-5.50%。

## 4.6 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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,260,747,558.65	93.45
	其中：股票	3,260,747,558.65	93.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	223,998,321.95	6.42
8	其他资产	4,491,148.39	0.13
9	合计	3,489,237,028.99	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股市值为人民币 9,307.07 元，占基金资产净值比例 0.00%；通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 90,720.23 元，占基金资产净值比例 0.00%。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,535,098,550.93	72.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	147,408.98	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	5,865.44	0.00

I	信息传输、软件和信息技术服务业	725,209,489.86	20.85
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	157,031.58	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	29,184.56	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,260,647,531.35	93.74

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费	-	-
必需消费品	90,720.23	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
科技	9,307.07	-
通讯	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
政府	-	-
合计	100,027.30	0.00

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	688023	安恒信息	929,031	327,947,943.00	9.43
2	688200	华峰测控	504,487	265,621,137.25	7.64
3	688301	奕瑞科技	499,058	209,005,490.40	6.01
4	688036	传音控股	1,248,912	176,096,592.00	5.06
5	688037	芯源微	707,124	172,608,968.40	4.96
6	688699	明微电子	554,691	151,597,050.30	4.36



7	688186	广大特材	2,157,261	114,723,139.98	3.30
8	688100	威胜信息	5,170,180	114,237,071.60	3.28
9	688008	澜起科技	1,911,203	113,544,570.23	3.26
10	688005	容百科技	1,041,439	112,558,727.12	3.24

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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

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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,039,961.26
2	应收证券清算款	3,426,891.20
3	应收股利	-
4	应收利息	24,295.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,491,148.39

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688200	华峰测控	207,448,000.00	5.96	科创板新股锁定期
2	688100	威胜信息	84,523,400.00	2.43	大宗交易锁定期
3	688100	威胜信息	26,995,200.00	0.78	询价转让

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,967,030,550.52
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,967,030,550.52

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、《南方科创板3年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方科创板3年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、南方科创板3年定期开放混合型证券投资基金2021年3季度报告原文。

### 9.2 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。

### 9.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>