

# 南方价值臻选混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会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。

本年度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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 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。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

## 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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	14
§5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告.....	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 净资产变动表.....	20
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告.....	57
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	58
8.3 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.....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	70

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
8.6 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.....	72
8.7 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.....	72
8.8 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.....	72
8.9 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.....	72
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
8.12 投资组合报告附注.....	73
§9 基金份额持有人信息.....	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
9.3 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.....	74
§10 开放式基金份额变动.....	75
§11 重大事件揭示.....	75
11.1 基金份额持有人大会决议.....	75
11.2 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.....	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	75
11.4 基金投资策略的改变.....	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
11.8 其他重大事件.....	80
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
12.1 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.....	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
§13 备查文件目录.....	82
13.1 备查文件目录.....	82
13.2 存放地点.....	83
13.3 查阅方式.....	83

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方价值臻选混合型证券投资基金	
基金简称	南方价值臻选混合	
基金主代码	012426	
交易代码	012426	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 21 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	393,800,896.12 份	
基金合同存续期		
下属分级基金的基金简称	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C
下属分级基金的交易代码	012426	012427
报告期末下属分级基金的份 额总额	373,731,393.55 份	20,069,502.57 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金依托于基金管理人的投资研究平台，紧密跟踪中国经济转型的发展方向，精选质地优秀、具备长期价值增长潜力的公司。股票投资采用定量和定性分析相结合的策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+上证国债指数收益率×50%
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。

### 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	中国工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
		郭明
		010-66105799
		custody@icbc.com.cn

客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码	518017	100140
法定代表人	周易	陈四清

## 2.4 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

##### 1、南方价值臻选混合 A

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年 6 月 21 日 -2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-12,297,299.71	-38,532,997.79	70,725,870.53
本期利润	-18,411,647.38	-76,738,376.89	82,372,662.21
加权平均基金份额本期利润	-0.0459	-0.1677	0.0741
本期加权平均净值利润率	-5.06%	-17.86%	7.19%
本期基金份额净值增长率	-5.57%	-15.10%	5.94%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-56,319,097.25	-43,058,257.57	29,832,306.21
期末可供分配基金份额利润	-0.1507	-0.1006	0.0594
期末基金资产净值	317,412,296.30	384,889,645.91	531,889,398.25
期末基金份额净值	0.8493	0.8994	1.0594
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-15.07%	-10.06%	5.94%

##### 2、南方价值臻选混合 C

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年 6 月 21 日 -2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-854,201.23	-2,059,858.24	2,460,570.76
本期利润	-1,377,377.53	-4,117,360.13	2,377,602.87
加权平均基金份额本期利润	-0.0626	-0.1796	0.0621
本期加权平均净值利润率	-7.00%	-19.24%	6.02%
本期基金份额净值增长率	-6.14%	-15.61%	5.61%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-3,281,309.11	-2,363,770.89	1,494,830.04
期末可供分配基金份额利润	-0.1635	-0.1088	0.0560
期末基金资产净值	16,788,193.46	19,353,046.61	28,163,238.19
期末基金份额净值	0.8365	0.8912	1.0561
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-16.35%	-10.88%	5.61%

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

南方价值臻选混合 A

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	-3.88%	0.61%	-2.91%	0.40%	-0.97%	0.21%
过去六个月	-7.34%	0.62%	-4.71%	0.42%	-2.63%	0.20%
过去一年	-5.57%	0.63%	-3.99%	0.42%	-1.58%	0.21%
自基金合同生效起至今	-15.07%	0.77%	-13.24%	0.54%	-1.83%	0.23%

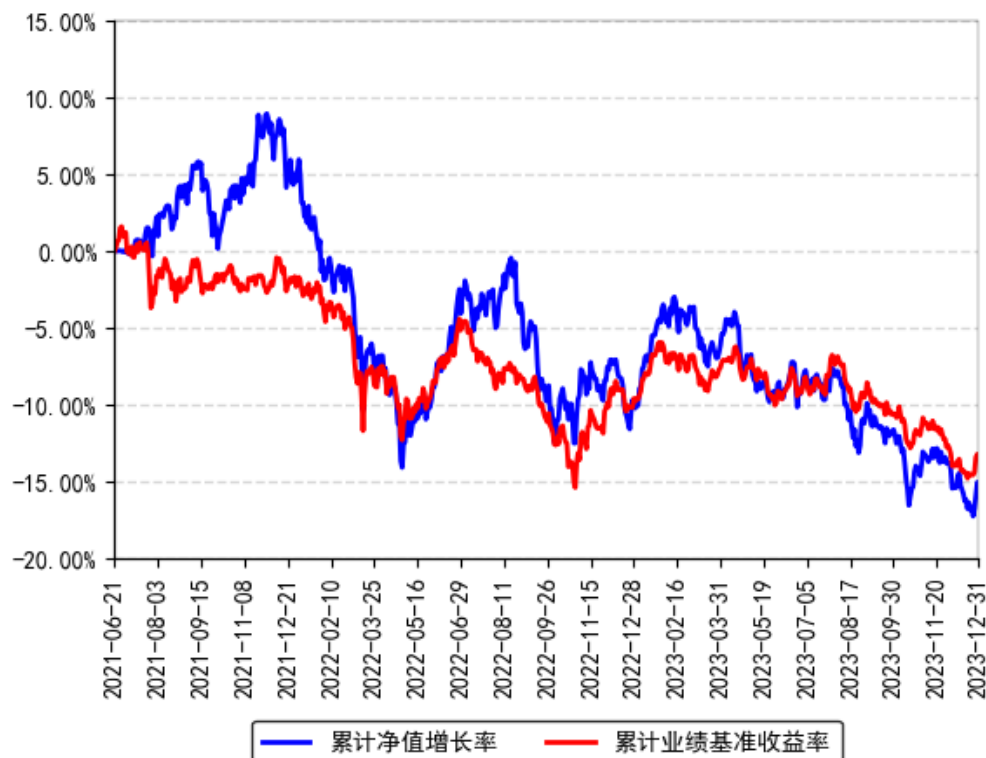
南方价值臻选混合 C

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	-4.03%	0.61%	-2.91%	0.40%	-1.12%	0.21%
过去六个月	-7.62%	0.62%	-4.71%	0.42%	-2.91%	0.20%
过去一年	-6.14%	0.63%	-3.99%	0.42%	-2.15%	0.21%
自基金合同生效起至今	-16.35%	0.77%	-13.24%	0.54%	-3.11%	0.23%

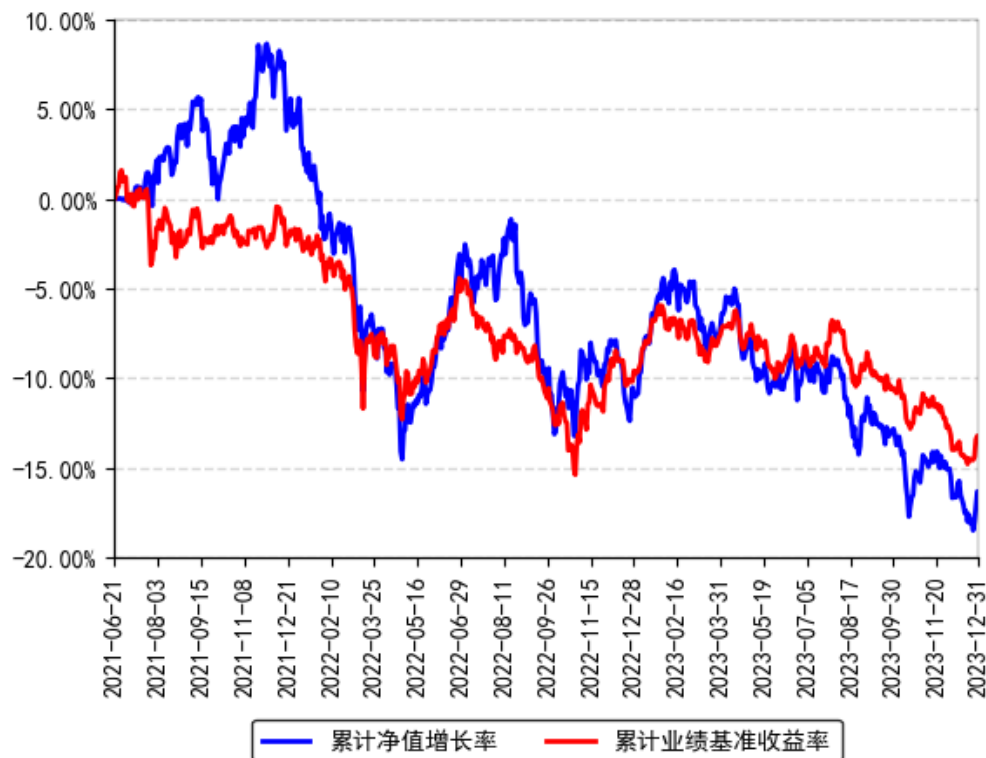
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



南方价值臻选混合A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

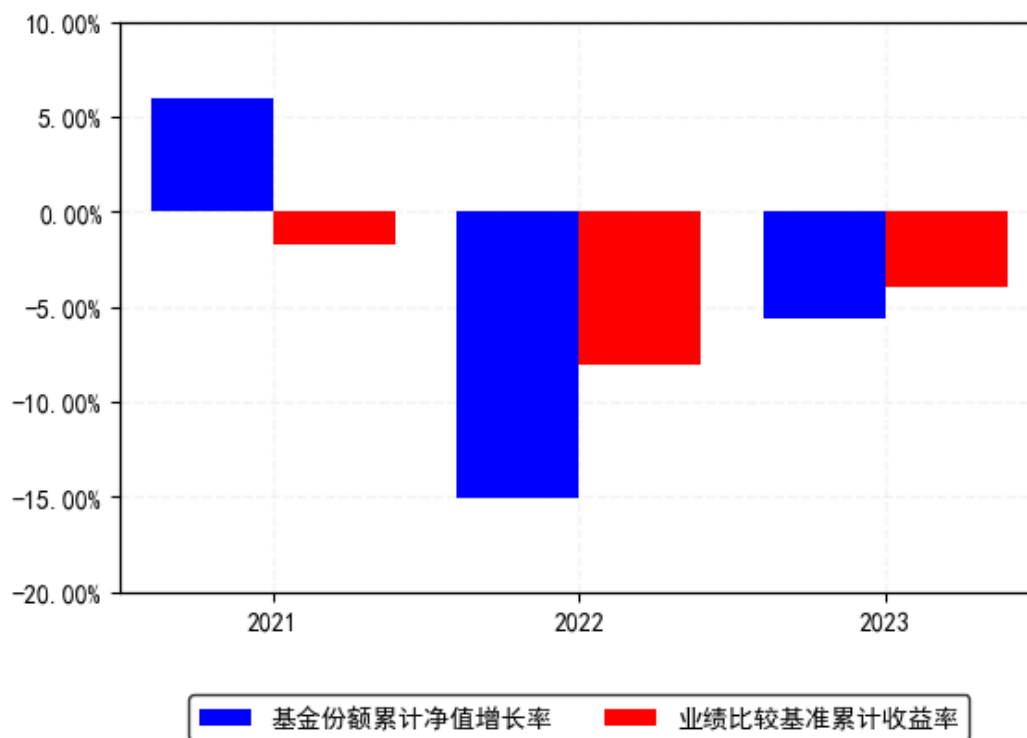


南方价值臻选混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

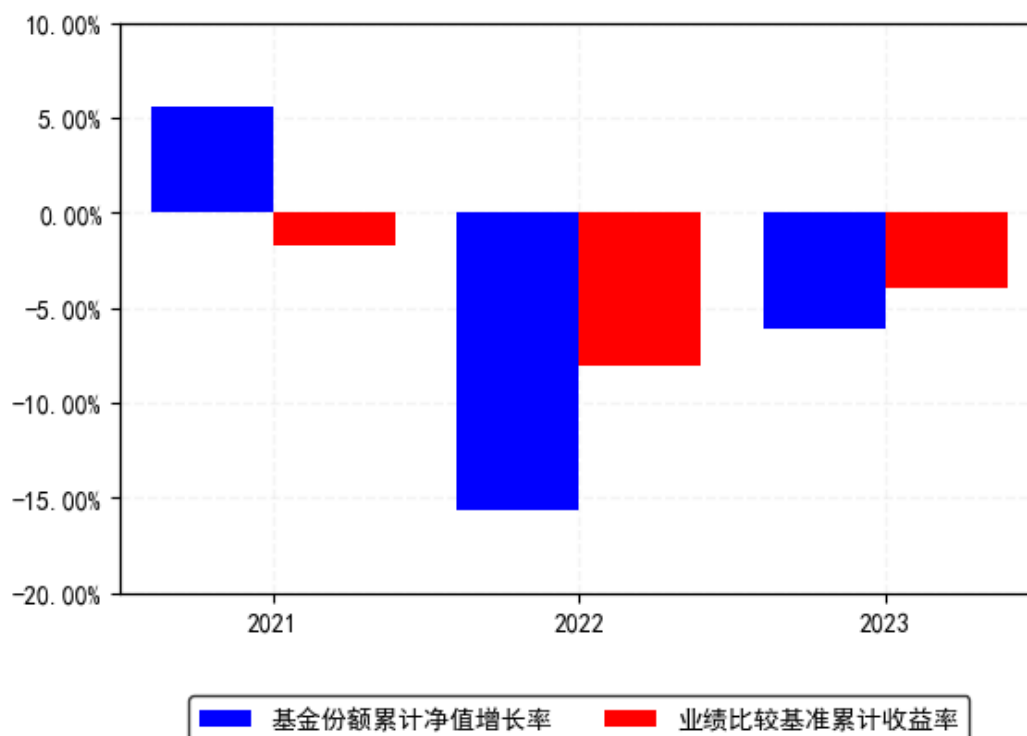


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方价值臻选混合A每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



南方价值臻选混合C每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2021 年 6 月 21 日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

## § 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。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		
卢玉珊	本基金基金经理	2021 年 6 月 21 日	-	15 年	女，清华大学会计学硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金，历任研究部研究员、高级研究员，负责纺织服装、商贸零售的行业研究工作；2015 年 2 月 26 日至 2015 年 12 月 30 日，任南方成份、南方安心的基金经理助理；2015 年 5 月 19 日至 2015 年 12 月 30 日，任南方改革机遇的基金经理助理；2015 年 12 月 30 日至 2019 年 1 月 9 日，任南方安心基金经理；2019 年 1 月 9 日至今，任南方核心竞争混合基金经理；2019 年 1 月 25 日至今，任南方改革机遇基金经理；2020 年 5 月 15 日至今，任南方君选基金经理；2021 年 6 月 21 日至今，任南方价值臻选混合基金经理；2022 年 2 月 7 日至今，任南方比较优势混合基金经理；2022 年 9 月 14 日至今，任南方鑫悦 15 个月持有混合基金经理；2022 年 11 月 15 日至今，任南方君誉混合基金经理。

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。

### 4.1.3 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由工资、奖金等构成。工资由基金经理任职的职位职级决定，重点体现员工能力和职位价值导向原则；奖金由员工的绩效贡献决定，重点体现绩效导向与差异化原则。对于兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理，公司对私募资产管理计划产生的超额业绩报酬实施对应激励，并依据其管理产品的长期业绩与个人综合贡献情况实施分配。为贯彻激励约束相结合、激励与约束并重的管理理念，鼓励长期任职，防范经营风险，公司对基金经理奖金实施递延发放；同时，为加强员工利益与持有人利益相捆绑及一致性，公司对基金经理实施了跟投购基机制，有效引导基金经理为客户持续创造价值。

## 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立和完善了兼任相关的制度及流程，确保兼任基金经理公平对待其管理的所有投资组合。通过对基金经理的投资交易行为进行监控和分析，本报告期内，两两组合间各项操作、流程及事后分析均正常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 4.3.3 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25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

2023年市场整体下跌，国证2000、中证1000为代表的小盘表现相对较好，创业板指、上证50跌幅较大；具体来看，沪深300、中证500、中证1000、创业板指表现分别为-11.38%，-7.42%，-6.28%，-19.41%。风格方面，2023年全年风格偏向小盘和价值。行业层面，通信、传媒、计算机为代表的TMT板块涨幅居前，分别上涨25.75%、16.8%、8.97%。另一方面，美容护理、商贸零售、房地产为代表的消费属性板块表现欠佳，分别下跌32.03%、31.3%、26.39%。

我们在年初低配了新能源、军工等竞争格局变差的中游行业，基于人口结构和收入预期的变化降低了消费行业的配置，增加了红利资产的配置，取得了一定的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金A份额净值为0.8493元，报告期内，份额净值增长率为-5.57%，同期业绩基准增长率为-3.99%；本基金C份额净值为0.8365元，报告期内，份额净值增长率为-6.14%，同期业绩基准增长率为-3.99%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场整体估值无论是相对自身历史，还是相对债券资产，均处于相对低估状态，以年度为展望，权益类资产仍是性价比较高的选择。对于标的的选择上，我们会更加看重竞争格局的稳定、资产负债表的稳健和自由现金流的健康。

展望后市，我们主要关注三条投资主线：一是现金流较好的低估值高股息的个股，包括运营商、能源、水电、高速公路等在内；二是出口链上具有国际竞争力的企业，比如家电、电力设备、纺织服装、医疗设备等；三是供需结构较好的上游资源品。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况，严格遵守包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求，有效落实了 2023 年度发布的《重要货币市场基金监管暂行规定》《基金从业人员管理规则》和《证券期货经营机构投资管理人员注册登记规则》等公募基金相关新法律法规。

本基金管理人坚持从保护基金份额持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础、合规为先、行稳致远”的合规理念。严守底线，始终把内控和合规管理作为规范化管理的重点，通过有效过程管控，将合规管理全面深度嵌入流程与业务，积极推动主动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，制订和修订了包括《合规手册》《数据合规管理规定》《从业人员个人投资管理办法》《防控内幕信息及交易管理制度》《信息和保密管理制度》《离任审计及审查制度》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在进一步优化制度体系的基础上，本基金管理人贯彻“合规为先，行稳致远”的合规理念，着力创新文化宣传方式，提升宣导效果；优化员工行为检查方式，加强员工行为规范检查力度，严格进行合规问责，强化全员合规、主动合规理念；对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展了定期稽核、专项稽核及多项自查，通过专项稽核和合规检查工作识别问题、防范风险、推动解决，促进公司业务合规运作、稳健经营；根据监管形势和市场形势的变化并结合业务发展的实际情况、各类组合或者业务特点，完善投资合规管理机制，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障新产品、新业务合规开展；积极开展合规审核工作，不断强化销售合规风险管控，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项

信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；开展各类监管组织的投教活动，提升投教质效；监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱相关工作，贯彻风险为本，自评估驱动，反洗钱重点问题解决方案实现落地推进。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程，有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全全部管理制度，不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性，持续全面推进合规数智化工作在更广范围应用并与合规管理工作深度融合，努力防范和管理各类风险，切实维护基金资产的安全与利益。

#### 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。

#### 4.8 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

本报告期内，本基金托管人在对南方价值臻选混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，南方价值臻选混合型证券投资基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方价值臻选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方价值臻选混合型证券投资基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(24)第 P00118 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方价值臻选混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了南方价值臻选混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则以及中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了南方价值臻选混合



	型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于南方价值臻选混合型证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>南方基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括南方价值臻选混合型证券投资基金年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则以及中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估南方价值臻选混合型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算南方价值臻选混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南方价值臻选混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判</p>

	<p>断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对南方价值臻选混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致南方价值臻选混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	汪芳 何淑婷
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：南方价值臻选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	21,021,993.43	76,933,956.74

结算备付金		116,037.50	555,114.13
存出保证金		37,036.80	70,732.36
交易性金融资产	7.4.7.2	276,861,337.09	328,360,702.04
其中：股票投资		263,604,413.55	304,573,183.81
基金投资		-	-
债券投资		13,256,923.54	23,787,518.23
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-4,363.36	70,000,000.00
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		38,820,840.85	329,274.84
应收股利		-	-
应收申购款		3,117.05	5,230.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		336,855,999.36	476,255,011.08
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,810,207.74	70,607,512.07
应付赎回款		305,170.91	463,679.15
应付管理人报酬		341,531.97	525,982.36
应付托管费		56,922.00	87,663.75
应付销售服务费		8,600.27	10,013.11
应付投资顾问费		-	-
应交税费		17.22	7.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	133,059.49	317,460.74
负债合计		2,655,509.60	72,012,318.56
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	393,800,896.12	449,664,720.98

其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-59,600,406.36	-45,422,028.46
净资产合计		334,200,489.76	404,242,692.52
负债和净资产总计		336,855,999.36	476,255,011.08

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，南方价值臻选混合 A 份额净值 0.8493 元，基金份额总额 373,731,393.55 份；南方价值臻选混合 C 份额净值 0.8365 元，基金份额总额 20,069,502.57 份；总份额合计 393,800,896.12 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方价值臻选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-13,351,686.41	-72,628,713.69
1.利息收入		386,683.13	1,119,697.61
其中：存款利息收入	7.4.7.9	242,518.17	397,431.87
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		144,164.96	722,265.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,122,306.99	-33,556,780.49
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-12,516,422.27	-38,312,937.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	327,432.85	628,560.59
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	5,066,682.43	4,127,596.53
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）	7.4.7.16	-6,637,523.97	-40,262,880.99
4.汇兑收益（损失以“-”		-	-

号填列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	21,461.42	71,250.18
减：二、营业总支出		6,437,338.50	8,227,023.33
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	5,253,420.57	6,778,660.33
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	875,570.08	1,129,776.83
3.销售服务费	7.4.10.2.3	118,128.05	128,818.64
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		15.71	4.56
8.其他费用	7.4.7.18	190,204.09	189,762.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,789,024.91	-80,855,737.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,789,024.91	-80,855,737.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-19,789,024.91	-80,855,737.02

### 7.3 净资产变动表

会计主体：南方价值臻选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	449,664,720.98	-	-45,422,028.46	404,242,692.52
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	449,664,720.98	-	-45,422,028.46	404,242,692.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-55,863,824.86	-	-14,178,377.90	-70,042,202.76

(一)、综合收益总额	-	-	-19,789,024.91	-19,789,024.91
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-55,863,824.86	-	5,610,647.01	-50,253,177.85
其中: 1.基金申购款	20,559,859.77	-	-1,872,707.19	18,687,152.58
2.基金赎回款	-76,423,684.63	-	7,483,354.20	-68,940,330.43
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	393,800,896.12	-	-59,600,406.36	334,200,489.76
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	528,725,500.19	-	31,327,136.25	560,052,636.44
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	528,725,500.19	-	31,327,136.25	560,052,636.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-79,060,779.21	-	-76,749,164.71	-155,809,943.92
(一)、综合收益总额	-	-	-80,855,737.02	-80,855,737.02
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-79,060,779.21	-	4,106,572.31	-74,954,206.90
其中: 1.基金申购	12,517,968.98	-	-790,519.54	11,727,449.44

款				
2.基金赎回款	-91,578,748.19	-	4,897,091.85	-86,681,656.34
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	449,664,720.98	-	-45,422,028.46	404,242,692.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_杨小松\_\_\_\_                      \_\_\_\_常克川\_\_\_\_                      \_\_\_\_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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

南方价值臻选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]767号《关于准予南方价值臻选混合型证券投资基金注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方价值臻选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,453,691,005.28元,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(21)第00284号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方价值臻选混合型证券投资基金基金合同》于2021年6月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,454,269,719.47份,其中认购资金利息折合578,714.19份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用、不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方价值臻选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票以及存托凭证(下同))、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(简称“港股通股票”)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权)以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为：本基金股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例范围为 30%-80%(其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%)。本基金每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+上证国债指数收益率×50%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2024 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币



本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

根据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，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分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。

金融资产的合同条款规定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，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产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计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

##### (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。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；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为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。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重

大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### (1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

#### (2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的金额确认，逐日确认债券利息并计入投资收益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息并计入投资收益。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息并记入投资收益。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券投资收益。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除权(息)日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

#### (3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### (4) 信用减值损失

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信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率在回购期内逐日计提。

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为同一类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中

基协发[2013]13号)相关规定,本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3)根据中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》,在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管

产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	21,021,993.43	76,933,956.74
等于：本金	21,016,972.60	76,926,529.85
加：应计利息	5,020.83	7,426.89
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	21,021,993.43	76,933,956.74

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		299,227,062.16	-	263,604,413.55	-35,622,648.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	12,813,470.00	157,386.10	13,256,923.54	286,067.44
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,813,470.00	157,386.10	13,256,923.54	286,067.44
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		312,040,532.16	157,386.10	276,861,337.09	-35,336,581.17
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		333,466,071.26	-	304,573,183.81	-28,892,887.45
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	23,223,422.70	370,265.28	23,787,518.23	193,830.25
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	23,223,422.70	370,265.28	23,787,518.23	193,830.25
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		356,689,493.96	370,265.28	328,360,702.04	-28,699,057.20

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元



项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-4,363.36	-
银行间市场	-	-
合计	-4,363.36	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	70,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	70,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.03	9.60
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	83,059.46	267,451.14
其中：交易所市场	83,059.46	267,451.14
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	50,000.00	50,000.00
合计	133,059.49	317,460.74

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方价值臻选混合 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	427,947,903.48	427,947,903.48
本期申购	6,573,672.54	6,573,672.54
本期赎回（以“-”号填列）	-60,790,182.47	-60,790,182.47
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	373,731,393.55	373,731,393.55

南方价值臻选混合 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	21,716,817.50	21,716,817.50
本期申购	13,986,187.23	13,986,187.23
本期赎回 (以“-”号填列)	-15,633,502.16	-15,633,502.16
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	20,069,502.57	20,069,502.57

注：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。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

南方价值臻选混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,763,391.49	-38,294,866.08	-43,058,257.57
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-4,763,391.49	-38,294,866.08	-43,058,257.57
本期利润	-12,297,299.71	-6,114,347.67	-18,411,647.38
本期基金份额交易产生的变动数	1,298,016.20	3,852,791.50	5,150,807.70
其中：基金申购款	-99,639.06	-354,966.83	-454,605.89
基金赎回款	1,397,655.26	4,207,758.33	5,605,413.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,762,675.00	-40,556,422.25	-56,319,097.25

南方价值臻选混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-428,403.16	-1,935,367.73	-2,363,770.89
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-428,403.16	-1,935,367.73	-2,363,770.89
本期利润	-854,201.23	-523,176.30	-1,377,377.53
本期基金份额交易产生的变动数	163,776.39	296,062.92	459,839.31
其中：基金申购款	-422,950.69	-995,150.61	-1,418,101.30
基金赎回款	586,727.08	1,291,213.53	1,877,940.61

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,118,828.00	-2,162,481.11	-3,281,309.11

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	233,958.71	340,661.87
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	7,657.69	54,200.05
其他	901.77	2,569.95
合计	242,518.17	397,431.87

#### 7.4.7.10 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	361,793,031.52	778,907,096.20
减：卖出股票成本总额	373,278,417.92	814,849,053.09
减：交易费用	1,031,035.87	2,370,980.72
买卖股票差价收入	-12,516,422.27	-38,312,937.61

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	351,460.53	437,479.75
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-24,027.68	191,080.84
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	327,432.85	628,560.59

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到	31,128,879.33	87,993,622.38

期兑付)成交总额		
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	30,482,952.70	85,859,706.10
减: 应计利息总额	669,946.60	1,942,808.85
减: 交易费用	7.71	26.59
买卖债券差价收入	-24,027.68	191,080.84

注: 上述交易费用(如有)包含债券买卖产生的交易费用。

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

##### 7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具其他投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,066,682.43	4,127,596.53
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	5,066,682.43	4,127,596.53

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-6,637,523.97	-40,262,880.99
——股票投资	-6,729,761.16	-40,491,851.44
——债券投资	92,237.19	228,970.45
——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	-6,637,523.97	-40,262,880.99

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	21,242.16	70,937.79
基金转换费收入	219.26	312.39
合计	21,461.42	71,250.18

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	780.00	907.00
其他	1,424.09	855.97
合计	190,204.09	189,762.97

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 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。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、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
厦门国际信托有限公司(“厦门国际信托”)	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司(“深圳投资控股”)	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
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
南方资本管理有限公司(“南方资本”)	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司(“南方东英”)	基金管理人的子公司

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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	90,745,187.22	13.21%	255,833,332.26	17.07%

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	140,227.73	0.71%	-	-

##### 7.4.10.1.3 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。

##### 7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	82,208.51	13.41%	3,188.79	3.84%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	233,556.69	17.07%	138,917.21	51.94%

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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,253,420.57	6,778,660.33
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,205,214.66	2,825,625.06
应支付基金管理人的净管理费	3,048,205.91	3,953,035.27

注：根据《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》，本基金自 2023 年 7 月 10 日(含)的管理费率由 1.50%/年调整为 1.20%/年。

1. 2023 年 1 月 1 日(含)-2023 年 7 月 9 日(含)：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 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。

2. 2023 年 7 月 10 日(含)-2023 年 12 月 31 日(含)：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 1.20%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×1.20%/当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	875,570.08	1,129,776.83

注：根据《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》，本基金自 2023 年 7 月 10 日(含)的托管费率由 0.25%/年调整为 0.20%/年。

1. 2023 年 1 月 1 日(含)-2023 年 7 月 9 日(含)：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 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。

2. 2023 年 7 月 10 日(含)-2023 年 12 月 31 日(含)：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/当年天数。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C	合计
工商银行	-	38,047.98	38,047.98
华泰证券	-	1,186.99	1,186.99
南方基金	-	18,321.69	18,321.69
兴业证券	-	194.04	194.04
合计	-	57,750.70	57,750.70
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C	合计
工商银行	-	46,004.06	46,004.06
华泰证券	-	2,003.64	2,003.64
南方基金	-	22,359.98	22,359.98
兴业证券	-	165.83	165.83
合计	-	70,533.51	70,533.51

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.60%/当年天数。

### 7.4.10.3 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。

### 7.4.10.4 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

#### 7.4.10.4.1 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。

#### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	21,021,993.43	233,958.71	76,933,956.74	340,661.87

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

#### 7.4.10.7 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 12 月 31 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	688472	阿特斯	网下申购	16,207	179,897.70
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	6,596	137,988.32
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合	301421	波长光电	网下申购	3,315	97,394.70
华泰联合	301519	舜禹股份	网下申购	4,414	92,385.02
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	301413	安培龙	网下申购	1,633	54,297.25
华泰联合	301566	达利凯普	网下申购	5,755	51,219.50
华泰联合	301487	盟固利	网下申购	8,662	46,081.84
华泰联合	688720	艾森股份	网下申购	1,644	46,081.32
华泰联合	118031	天 23 转债	配债	270	27,000.00

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	1,302	170,705.22
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	2,253	72,749.37
兴业证券	301578	辰奕智能	网下申购	1,175	57,504.50
兴业证券,华泰联合	688469	芯联集成	网下申购	47,332	269,319.08

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	301327	华宝新能	网下申购	1,692	401,850.00
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	12,070	271,937.10
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	3,247	262,357.60
华泰联合	113062	常银转债	配债	2,370	237,000.00
华泰联合	301195	北路智控	网下申购	3,000	213,510.00
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	3,387	192,652.56
华泰联合	688420	美腾科技	网下申购	2,408	117,895.68
华泰联合	123145	药石转债	配债	489	48,900.00
华泰联合	301316	慧博云通	网下申购	3,584	27,238.40
华泰联合	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
兴业证券	113653	永 22 转债	配债	9,090	909,000.00
兴业证券	600030	中信证券	配股	17,460	251,947.80
兴业证券	603280	南方路机	网下申购	363	8,621.25

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

#### 7.4.11 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。

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
301487	盟固利	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股锁定期	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301526	国际复材	2023	6 个月	新股锁	2.66	4.45	5,158	13,720.28	22,953.10	-

		年 12 月 19 日		定期						
301370	国科恒泰	2023 年 7 月 3 日	6 个月	新股锁定期	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301421	波长光电	2023 年 8 月 16 日	6 个月	新股锁定期	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
688627	精智达	2023 年 7 月 11 日	6 个月	新股锁定期	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
301558	三态股份	2023 年 9 月 21 日	6 个月	新股锁定期	7.33	13.40	1,377	10,093.41	18,451.80	-
688548	广钢气体	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新股锁定期	9.87	12.75	1,431	14,123.97	18,245.25	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定期	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
688563	航材股份	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股锁定期	78.99	60.49	294	23,223.06	17,784.06	-
688549	中巨芯	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股锁定期	5.18	8.09	2,074	10,743.32	16,778.66	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定期	26.74	38.67	413	11,043.62	15,970.71	-
301509	金凯生科	2023 年 7 月 26 日	6 个月	新股锁定期	56.56	62.23	251	14,196.56	15,619.73	-
688591	泰凌微	2023 年 8 月 18 日	6 个月	新股锁定期	24.98	28.02	522	13,039.56	14,626.44	-
301362	民爆光电	2023 年 7 月 27 日	6 个月	新股锁定期	51.05	38.52	378	19,296.90	14,560.56	-
688652	京仪装备	2023 年 11 月 22 日	6 个月	新股锁定期	31.95	52.25	271	8,658.45	14,159.75	-
301510	固高科技	2023 年 8 月 4 日	6 个月	新股锁定期	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-

301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定期	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股锁定期	42.66	48.18	258	11,006.28	12,430.44	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定期	57.66	47.25	250	14,415.00	11,812.50	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股锁定期	67.68	59.37	193	13,062.24	11,458.41	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股锁定期	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股锁定期	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股锁定期	37.56	43.57	252	9,465.12	10,979.64	-
688592	司南导航	2023年8月7日	6个月	新股锁定期	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股锁定期	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股锁定期	37.96	30.39	344	13,058.24	10,454.16	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定期	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股锁定期	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新股锁定期	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股锁定期	1.70	4.06	2,511	4,268.70	10,194.66	-
301372	科净源	2023年8月	6个月	新股锁定期	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-

		3 日								
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
688716	中研股份	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
301413	安培龙	2023 年 12 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023 年 8 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301516	中远通	2023 年 12 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301519	舜禹股份	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
688719	爱科赛博	2023 年 9 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	69.98	60.10	146	10,217.08	8,774.60	-
301525	儒竞科技	2023 年 8 月 23 日	6 个月	新股锁 定期	99.57	81.46	106	10,554.42	8,634.76	-
301500	飞南资源	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	23.97	20.89	398	9,540.06	8,314.22	-
301459	丰茂股份	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301559	中集环科	2023 年 9 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	24.22	18.24	451	10,923.22	8,226.24	-
688720	艾森股份	2023 年 11 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
301489	思泉新材	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
688651	盛邦安全	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
301520	万邦医药	2023	6 个月	新股锁	67.88	52.74	154	10,453.52	8,121.96	-

		年 9 月 18 日		定期							
301517	陕西华达	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-	
301578	辰奕智能	2023 年 12 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-	
688646	逸飞激光	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-	
301371	敷尔佳	2023 年 7 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	55.68	37.58	207	11,525.76	7,779.06	-	
688612	威迈斯	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	47.29	37.97	200	9,458.00	7,594.00	-	
301548	崇德科技	2023 年 9 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	66.80	58.99	127	8,483.60	7,491.73	-	
301533	威马农机	2023 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁 定期	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-	
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-	
301505	苏州规划	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-	
301529	福赛科技	2023 年 8 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-	
601083	锦江航运	2023 年 11 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	11.25	11.07	598	6,727.50	6,619.86	-	
301515	港通医疗	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-	
688648	中邮科技	2023 年 11 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-	
688450	光格科技	2023 年 7 月 17 日	6 个月	新股锁 定期	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-	

603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股锁定期	16.80	31.19	188	3,158.40	5,863.72	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股锁定期	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603275	众辰科技	2023年8月16日	6个月	新股锁定期	49.97	39.70	127	6,346.19	5,041.90	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股锁定期	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股锁定期	15.32	23.87	202	3,094.64	4,821.74	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股锁定期	14.23	18.19	248	3,529.04	4,511.12	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股锁定期	17.38	16.66	248	4,310.24	4,131.68	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股锁定期	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股锁定期	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股锁定期	23.10	23.31	153	3,534.30	3,566.43	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股锁定期	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股锁定期	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股锁定期	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-

## 7.4.12.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金持有的上述流通受限证券，根据中国证监会、证券交易所发布的相关规定，在受限期内不得转让：

1. 根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2. 基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3. 根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### **7.4.12.2 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。

#### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **7.4.12.3.1 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。

##### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### **7.4.12.4 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。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金是混合型基金，其预期风险和收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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险管理部负责,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。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户,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。

于本报告期末,本基金持有的除国债、央行票据及政策性金融债以外的债券占基金净资产的比例为 0.63%(上年度末: 0.43%)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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。

于本报告期末,本基金的卖出回购金融资产款(若有)计息且利息金额不重大;除此之外,本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,该部分账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金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,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超过基金资产净值的 15%。于本报告期末,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符合该要求。

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。于本报告期末,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	21,021,993.43	-	-	-	21,021,993.43
结算备付金	116,037.50	-	-	-	116,037.50
存出保证金	37,036.80	-	-	-	37,036.80
交易性金融资产	11,156,169.86	1,716,468.48	384,285.20	263,604,413.55	276,861,337.09
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-4,363.36	-	-	-	-4,363.36
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	38,820,840.85	38,820,840.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	20.00	-	-	3,097.05	3,117.05
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	32,326,894.23	1,716,468.48	384,285.20	302,428,351.45	336,855,999.36
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	-	-	-	1,810,207.74	1,810,207.74
应付赎回款	-	-	-	305,170.91	305,170.91
应付管理人报酬	-	-	-	341,531.97	341,531.97
应付托管费	-	-	-	56,922.00	56,922.00
应付销售服务费	-	-	-	8,600.27	8,600.27
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	17.22	17.22
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	133,059.49	133,059.49
负债总计	-	-	-	2,655,509.60	2,655,509.60
利率敏感度缺口	32,326,894.23	1,716,468.48	384,285.20	299,772,841.85	334,200,489.76
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					
货币资金	76,933,956.74	-	-	-	76,933,956.74
结算备付金	555,114.13	-	-	-	555,114.13
存出保证金	70,732.36	-	-	-	70,732.36
交易性金融资产	22,059,618.25	-	1,727,899.98	304,573,183.81	328,360,702.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	70,000,000.00	-	-	-	70,000,000.00
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	329,274.84	329,274.84
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	90.00	-	-	5,140.97	5,230.97

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	169,619,511.48	-	1,727,899.98	304,907,599.62	476,255,011.08
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	-	-	-	70,607,512.07	70,607,512.07
应付赎回款	-	-	-	463,679.15	463,679.15
应付管理人报酬	-	-	-	525,982.36	525,982.36
应付托管费	-	-	-	87,663.75	87,663.75
应付销售服务费	-	-	-	10,013.11	10,013.11
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7.38	7.38
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	317,460.74	317,460.74
负债总计	-	-	-	72,012,318.56	72,012,318.56
利率敏感度缺口	169,619,511.48	-	1,727,899.98	232,895,281.06	404,242,692.52

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-345.26	-40,082.08
2.市场利率平行下降25个基点	359.41	40,536.68	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产或负债，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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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						
交易性金融资产	-	8,805,924.61	-	-	-	8,805,924.61
资产合计	-	8,805,924.61	-	-	-	8,805,924.61
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	-	8,805,924.61	-	-	-	8,805,924.61

项目	上年度末 2022 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						
交易性金融资产	-	17,900,987.90	-	-	-	17,900,987.90
资产合计	-	17,900,987.90	-	-	-	17,900,987.90
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	-	17,900,987.90	-	-	-	17,900,987.90

##### 7.4.13.4.2.2 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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
1. 所有外币相对人民币升值 5%	440,296.23	895,049.40
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-440,296.23	-895,049.40

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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。本基金的投资组合比例为：本基金股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例范围为 30%-80%（其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%）。本基金每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	263,604,413.55	78.88	304,573,183.81	75.34
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	263,604,413.55	78.88	304,573,183.81	75.34

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 上升 5%	10,976,398.29	15,581,427.82
	2. 沪深 300 下降 5%	-10,976,398.29	-15,581,427.82

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	264,955,169.24	302,745,628.64
第二层次	11,156,169.86	22,293,039.79
第三层次	749,997.99	3,322,033.61
合计	276,861,337.09	328,360,702.04

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元



项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票	
期初余额	-	3,322,033.61	3,322,033.61
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,512,340.78	1,512,340.78
转出第三层次	-	4,920,722.05	4,920,722.05
当期利得或损失总额	-	836,345.65	836,345.65
其中：计入损益的利得或损失	-	836,345.65	836,345.65
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	749,997.99	749,997.99
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	150,023.77	150,023.77
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票	
期初余额	-	3,463,819.70	3,463,819.70
当期购买	-	1,999,998.90	1,999,998.90
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,520,487.94	2,520,487.94
转出第三层次	-	6,131,631.66	6,131,631.66
当期利得或损失总额	-	1,469,358.73	1,469,358.73
其中：计入损益的利得或损失	-	1,469,358.73	1,469,358.73
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	3,322,033.61	3,322,033.61
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	397,346.35	397,346.35

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平	与公允价值

				均值	之间的关系
限售股票	749,997.99	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962-2.1988	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	3,322,033.61	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2319-2.4756	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	263,604,413.55	78.25
	其中：股票	263,604,413.55	78.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,256,923.54	3.94
	其中：债券	13,256,923.54	3.94
	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	-4,363.36	0.00
	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	21,138,030.93	6.28
8	其他资产	38,860,994.70	11.54
9	合计	336,855,999.36	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 5,056,221.86 元，占基金资产净值比例 1.51%；通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 3,749,702.75 元，占基金资产净值比例 1.12%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	1,023,086.00	0.31
B	采矿业	22,510,914.50	6.74
C	制造业	170,393,100.58	50.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,213,366.85	3.06
E	建筑业	5,706,545.00	1.71
F	批发和零售业	4,704,522.20	1.41
G	交通运输、仓储和邮政业	7,362,482.82	2.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,497,653.33	4.04
J	金融业	8,435,765.77	2.52
K	房地产业	1,936,798.00	0.58
L	租赁和商务服务业	3,282,398.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	962,140.12	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	2,332,014.61	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	551,241.16	0.16
R	文化、体育和娱乐业	1,505,240.00	0.45
S	综合	381,220.00	0.11
	合计	254,798,488.94	76.24

### 8.2.2 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	648,744.77	0.19
材料	1,507,922.89	0.45
工业	515,929.17	0.15
非必需消费	723,507.93	0.22
必需消费品	-	-
医疗保健	2,915,173.81	0.87
金融	-	-
科技	141,252.51	0.04

通讯	2,353,393.53	0.70
公用事业	-	-
房地产	-	-
政府	-	-
合计	8,805,924.61	2.63

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	6,500	11,219,000.00	3.36
2	601857	中国石油	526,500	3,717,090.00	1.11
3	000333	美的集团	61,600	3,365,208.00	1.01
4	002318	久立特材	163,500	3,250,380.00	0.97
5	300750	宁德时代	18,360	2,997,453.60	0.90
6	000975	银泰黄金	174,200	2,613,000.00	0.78
7	600886	国投电力	198,200	2,612,276.00	0.78
8	600900	长江电力	111,800	2,609,412.00	0.78
9	002028	思源电气	49,400	2,570,776.00	0.77
10	300122	智飞生物	37,700	2,303,847.00	0.69
11	603871	嘉友国际	135,836	2,154,358.96	0.64
12	000651	格力电器	66,200	2,129,654.00	0.64
13	600323	瀚蓝环境	120,000	2,079,600.00	0.62
14	601567	三星医疗	98,800	2,025,400.00	0.61
15	688737	中自科技	60,346	1,997,452.60	0.60
16	601899	紫金矿业	155,200	1,933,792.00	0.58
17	000923	河钢资源	114,800	1,928,640.00	0.58
18	600030	中信证券	92,560	1,885,447.20	0.56
19	000100	TCL 科技	411,424	1,769,123.20	0.53
20	002092	中泰化学	281,000	1,714,100.00	0.51
21	601985	中国核电	227,900	1,709,250.00	0.51
22	600079	人福医药	68,600	1,705,396.00	0.51
23	601225	陕西煤业	79,300	1,656,577.00	0.50
24	688772	珠海冠宇	74,457	1,638,798.57	0.49
25	600963	岳阳林纸	277,600	1,635,064.00	0.49
26	002415	海康威视	46,700	1,621,424.00	0.49
27	601966	玲珑轮胎	84,100	1,617,243.00	0.48
28	002475	立讯精密	46,500	1,601,925.00	0.48
29	000338	潍柴动力	117,300	1,601,145.00	0.48

30	600585	海螺水泥	68,700	1,549,872.00	0.46
31	600346	恒力石化	116,900	1,539,573.00	0.46
32	600150	中国船舶	51,600	1,519,104.00	0.45
33	603833	欧派家居	21,600	1,503,576.00	0.45
34	688333	铂力特	12,472	1,445,504.80	0.43
35	002126	银轮股份	76,700	1,431,989.00	0.43
36	601702	华峰铝业	79,400	1,425,230.00	0.43
37	002142	宁波银行	68,410	1,375,725.10	0.41
38	600012	皖通高速	123,600	1,362,072.00	0.41
39	600285	羚锐制药	79,400	1,358,534.00	0.41
40	002138	顺络电子	50,000	1,350,500.00	0.40
41	300165	天瑞仪器	201,200	1,342,004.00	0.40
42	300782	卓胜微	9,500	1,339,500.00	0.40
43	605090	九丰能源	47,500	1,326,675.00	0.40
44	000708	中信特钢	94,200	1,322,568.00	0.40
45	603979	金诚信	34,800	1,314,048.00	0.39
46	600566	济川药业	41,700	1,310,631.00	0.39
47	002517	恺英网络	117,100	1,308,007.00	0.39
48	002583	海能达	216,700	1,289,365.00	0.39
49	688012	中微公司	8,375	1,286,400.00	0.38
50	600188	兖矿能源	63,850	1,264,868.50	0.38
51	002595	豪迈科技	42,200	1,256,294.00	0.38
52	600497	驰宏锌锗	244,200	1,233,210.00	0.37
53	600029	南方航空	122,400	705,024.00	0.21
54	01055	中国南方航空股份	172,000	515,929.17	0.15
55	300638	广和通	64,100	1,219,823.00	0.36
56	600546	山煤国际	68,900	1,206,439.00	0.36
57	600859	王府井	74,700	1,192,959.00	0.36
58	600298	安琪酵母	33,900	1,192,602.00	0.36
59	601668	中国建筑	247,500	1,190,475.00	0.36
60	300408	三环集团	39,514	1,163,687.30	0.35
61	002073	软控股份	175,400	1,152,378.00	0.34
62	601600	中国铝业	203,610	1,148,360.40	0.34
63	601088	中国神华	36,400	1,141,140.00	0.34
64	600584	长电科技	38,200	1,140,652.00	0.34
65	600970	中材国际	120,000	1,120,800.00	0.34
66	603878	武进不锈	148,000	1,117,400.00	0.33
67	600685	中船防务	43,400	1,108,870.00	0.33
68	603129	春风动力	10,800	1,104,192.00	0.33
69	002938	鹏鼎控股	48,600	1,084,752.00	0.32
70	600048	保利发展	109,500	1,084,050.00	0.32
71	600741	华域汽车	64,900	1,056,572.00	0.32

72	001326	联域股份	18,948	1,044,603.24	0.31
73	002493	荣盛石化	100,350	1,038,622.50	0.31
74	605168	三人行	16,200	1,026,432.00	0.31
75	002749	国光股份	83,900	1,005,122.00	0.30
76	688777	中控技术	21,897	993,028.95	0.30
77	601601	中国太保	41,100	977,358.00	0.29
78	002080	中材科技	61,200	974,304.00	0.29
79	600176	中国巨石	99,043	973,592.69	0.29
80	603087	甘李药业	18,300	963,495.00	0.29
81	600398	海澜之家	128,100	950,502.00	0.28
82	601618	中国中冶	307,700	941,562.00	0.28
83	688786	悦安新材	21,182	941,328.08	0.28
84	000063	中兴通讯	35,400	937,392.00	0.28
85	000776	广发证券	65,443	935,180.47	0.28
86	688008	澜起科技	15,891	933,755.16	0.28
87	600803	新奥股份	55,400	931,828.00	0.28
88	002864	盘龙药业	24,100	927,609.00	0.28
89	01378	中国宏桥	159,000	920,728.58	0.28
90	688677	海泰新光	17,241	917,738.43	0.27
91	000403	派林生物	33,500	912,540.00	0.27
92	002984	森麒麟	31,600	911,660.00	0.27
93	603345	安井食品	8,700	910,107.00	0.27
94	603279	景津装备	40,800	902,088.00	0.27
95	600941	中国移动	5,500	547,140.00	0.16
96	00941	中国移动	6,000	352,338.34	0.11
97	002675	东诚药业	49,000	898,170.00	0.27
98	002352	顺丰控股	22,100	892,840.00	0.27
99	600332	白云山	30,900	883,740.00	0.26
100	00700	腾讯控股	3,300	878,018.43	0.26
101	003021	兆威机电	9,300	874,107.00	0.26
102	002444	巨星科技	38,800	873,776.00	0.26
103	603236	移远通信	16,190	870,212.50	0.26
104	600409	三友化工	158,500	870,165.00	0.26
105	000997	新大陆	44,100	864,801.00	0.26
106	000811	冰轮环境	63,700	864,409.00	0.26
107	002531	天顺风能	74,500	864,200.00	0.26
108	001914	招商积余	71,300	852,748.00	0.26
109	600028	中国石化	129,600	723,168.00	0.22
110	00386	中国石油化工股份	32,000	118,606.07	0.04
111	300316	晶盛机电	19,000	837,710.00	0.25
112	600993	马应龙	34,600	836,628.00	0.25
113	002027	分众传媒	130,800	826,656.00	0.25

114	600026	中远海能	66,500	813,960.00	0.24
115	300979	华利集团	15,400	810,656.00	0.24
116	002841	视源股份	17,400	796,224.00	0.24
117	601728	中国电信	146,700	793,647.00	0.24
118	300389	艾比森	45,400	787,236.00	0.24
119	002078	太阳纸业	64,600	786,182.00	0.24
120	300627	华测导航	25,300	784,806.00	0.23
121	605177	东亚药业	29,200	773,216.00	0.23
122	600845	宝信软件	15,500	756,400.00	0.23
123	002368	太极股份	25,600	755,968.00	0.23
124	01548	金斯瑞生物科技	42,000	755,896.23	0.23
125	301391	卡莱特	6,588	754,194.24	0.23
126	002463	沪电股份	33,900	749,868.00	0.22
127	300747	锐科激光	31,710	746,136.30	0.22
128	002532	天山铝业	124,100	745,841.00	0.22
129	000739	普洛药业	48,400	744,876.00	0.22
130	003019	宸展光电	32,920	743,992.00	0.22
131	002737	葵花药业	28,500	740,430.00	0.22
132	688121	卓然股份	36,316	734,672.68	0.22
133	601607	上海医药	43,900	734,447.00	0.22
134	300130	新国都	30,200	730,840.00	0.22
135	688078	龙软科技	18,049	727,735.68	0.22
136	300772	运达股份	68,224	725,903.36	0.22
137	06078	海吉亚医疗	22,600	722,964.19	0.22
138	01024	快手-W	15,000	719,765.24	0.22
139	002803	吉宏股份	34,900	717,544.00	0.21
140	601528	瑞丰银行	143,520	710,424.00	0.21
141	301367	怡和嘉业	5,819	708,463.25	0.21
142	688789	宏华数科	7,017	701,068.47	0.21
143	600062	华润双鹤	37,600	699,360.00	0.21
144	600612	老凤祥	10,100	696,900.00	0.21
145	603093	南华期货	58,000	696,000.00	0.21
146	603619	中曼石油	37,100	687,092.00	0.21
147	603337	杰克股份	31,700	684,720.00	0.20
148	688266	泽璟制药	12,917	683,825.98	0.20
149	600927	永安期货	43,400	681,814.00	0.20
150	002311	海大集团	15,100	678,141.00	0.20
151	300054	鼎龙股份	27,800	672,760.00	0.20
152	688232	新点软件	18,425	666,985.00	0.20
153	600820	隧道股份	115,300	664,128.00	0.20
154	000999	华润三九	13,300	661,409.00	0.20
155	002448	中原内配	99,400	660,016.00	0.20

156	600256	广汇能源	92,200	658,308.00	0.20
157	002299	圣农发展	38,300	657,994.00	0.20
158	002815	崇达技术	68,000	651,440.00	0.19
159	603993	洛阳钼业	125,100	650,520.00	0.19
160	06160	百济神州	6,500	648,536.34	0.19
161	000928	中钢国际	110,400	643,632.00	0.19
162	603277	银都股份	23,800	638,316.00	0.19
163	002756	永兴材料	12,090	631,218.90	0.19
164	603596	伯特利	9,100	630,630.00	0.19
165	002128	电投能源	44,100	629,307.00	0.19
166	300413	芒果超媒	24,900	627,480.00	0.19
167	300182	捷成股份	123,200	625,856.00	0.19
168	600348	华阳股份	64,050	625,128.00	0.19
169	605377	华旺科技	32,300	616,607.00	0.18
170	000922	佳电股份	60,000	616,200.00	0.18
171	601111	中国国航	82,800	607,752.00	0.18
172	300481	濮阳惠成	34,500	602,025.00	0.18
173	600499	科达制造	56,800	599,240.00	0.18
174	002384	东山精密	32,800	596,304.00	0.18
175	688037	芯源微	4,438	592,961.18	0.18
176	300260	新莱应材	19,360	589,124.80	0.18
177	600790	轻纺城	148,200	588,354.00	0.18
178	03323	中国建材	194,000	587,194.31	0.18
179	688484	南芯科技	14,708	586,113.80	0.18
180	688021	奥福环保	27,929	582,319.65	0.17
181	603195	公牛集团	6,068	580,404.20	0.17
182	600998	九州通	81,980	574,679.80	0.17
183	688377	迪威尔	21,259	570,166.38	0.17
184	603613	国联股份	25,600	563,456.00	0.17
185	603259	药明康德	7,700	560,252.00	0.17
186	000848	承德露露	70,100	550,285.00	0.16
187	000690	宝新能源	123,700	547,991.00	0.16
188	603297	永新光学	5,500	546,425.00	0.16
189	300845	捷安高科	30,100	543,907.00	0.16
190	603338	浙江鼎力	10,600	542,402.00	0.16
191	600131	国网信通	35,800	542,370.00	0.16
192	603368	柳药集团	28,600	541,112.00	0.16
193	00883	中国海洋石油	45,000	530,138.70	0.16
194	600276	恒瑞医药	11,500	520,145.00	0.16
195	603738	泰晶科技	31,696	518,229.60	0.16
196	00425	敏实集团	36,000	514,805.46	0.15
197	601058	赛轮轮胎	43,200	507,600.00	0.15



198	300058	蓝色光标	69,700	500,446.00	0.15
199	688050	爱博医疗	2,908	500,292.32	0.15
200	688639	华恒生物	3,914	492,772.60	0.15
201	002603	以岭药业	21,200	489,084.00	0.15
202	000921	海信家电	23,900	487,560.00	0.15
203	688169	石头科技	1,723	487,522.85	0.15
204	301051	信濠光电	7,600	483,892.00	0.14
205	02269	药明生物	18,000	482,834.02	0.14
206	600547	山东黄金	21,100	482,557.00	0.14
207	688696	极米科技	4,229	477,792.42	0.14
208	002049	紫光国微	7,000	472,150.00	0.14
209	000951	中国重汽	34,900	466,264.00	0.14
210	688003	天准科技	12,363	463,859.76	0.14
211	000807	云铝股份	37,900	463,138.00	0.14
212	603179	新泉股份	9,100	461,461.00	0.14
213	301122	采纳股份	13,600	460,496.00	0.14
214	603039	泛微网络	9,800	459,620.00	0.14
215	688120	华海清科	2,426	455,360.20	0.14
216	300308	中际旭创	4,000	451,640.00	0.14
217	000623	吉林敖东	29,700	449,658.00	0.13
218	688386	泛亚微透	10,881	443,944.80	0.13
219	000883	湖北能源	104,900	443,727.00	0.13
220	002643	万润股份	26,600	441,294.00	0.13
221	300628	亿联网络	14,800	437,340.00	0.13
222	688668	鼎通科技	7,903	437,193.96	0.13
223	002327	富安娜	48,100	430,495.00	0.13
224	300873	海晨股份	17,900	426,199.00	0.13
225	301486	致尚科技	8,750	419,217.50	0.13
226	600872	中炬高新	14,900	418,690.00	0.13
227	600528	中铁工业	55,600	413,664.00	0.12
228	002555	三七互娱	21,800	410,058.00	0.12
229	601877	正泰电器	19,000	408,690.00	0.12
230	002602	世纪华通	79,000	407,640.00	0.12
231	600511	国药股份	14,200	406,404.00	0.12
232	601717	郑煤机	31,600	399,740.00	0.12
233	300534	陇神戎发	40,100	395,787.00	0.12
234	601390	中国中铁	68,800	390,784.00	0.12
235	601233	桐昆股份	25,800	390,354.00	0.12
236	300633	开立医疗	8,200	387,860.00	0.12
237	002051	中工国际	47,700	387,324.00	0.12
238	000516	国际医学	47,300	383,603.00	0.11
239	600603	广汇物流	49,000	381,220.00	0.11
240	002831	裕同科技	13,800	379,638.00	0.11

241	833533	骏创科技	17,706	376,960.74	0.11
242	603606	东方电缆	8,700	371,925.00	0.11
243	605555	德昌股份	16,196	370,078.60	0.11
244	601918	新集能源	70,100	369,427.00	0.11
245	601800	中国交建	48,400	367,840.00	0.11
246	688036	传音控股	2,654	367,313.60	0.11
247	300559	佳发教育	23,600	365,800.00	0.11
248	300498	温氏股份	18,200	365,092.00	0.11
249	300442	润泽科技	14,300	362,791.00	0.11
250	000983	山西焦煤	36,700	362,596.00	0.11
251	300766	每日互动	23,400	361,062.00	0.11
252	000568	泸州老窖	2,000	358,840.00	0.11
253	600066	宇通客车	26,800	355,100.00	0.11
254	002185	华天科技	41,500	353,580.00	0.11
255	600587	新华医疗	13,600	350,744.00	0.10
256	301269	华大九天	3,300	349,305.00	0.10
257	300168	万达信息	41,100	348,528.00	0.10
258	688091	上海谊众	5,405	345,920.00	0.10
259	002011	盾安环境	25,100	345,125.00	0.10
260	689009	九号公司	11,621	344,678.86	0.10
261	688622	禾信仪器	9,534	342,747.30	0.10
262	603228	景旺电子	15,045	339,415.20	0.10
263	601138	工业富联	22,400	338,688.00	0.10
264	000935	四川双马	18,900	338,688.00	0.10
265	000938	紫光股份	17,500	338,625.00	0.10
266	600415	小商品城	46,100	337,452.00	0.10
267	000408	藏格矿业	13,300	337,022.00	0.10
268	000661	长春高新	2,300	335,340.00	0.10
269	688190	云路股份	4,679	335,156.77	0.10
270	600985	淮北矿业	20,100	334,263.00	0.10
271	603986	兆易创新	3,600	332,604.00	0.10
272	002100	天康生物	37,400	327,998.00	0.10
273	688502	茂莱光学	1,509	327,437.91	0.10
274	600782	新钢股份	93,100	324,919.00	0.10
275	688211	中科微至	8,819	323,392.73	0.10
276	601555	东吴证券	44,000	321,640.00	0.10
277	301308	江波龙	3,400	312,970.00	0.09
278	688028	沃尔德	12,491	310,900.99	0.09
279	688456	有研粉材	10,920	307,616.40	0.09
280	02096	先声药业	50,000	304,943.03	0.09
281	688392	骄成超声	3,651	304,529.91	0.09
282	600428	中远海特	56,400	302,304.00	0.09
283	605286	同力日升	10,100	301,586.00	0.09

284	603960	克来机电	19,500	289,965.00	0.09
285	002884	凌霄泵业	16,300	282,968.00	0.08
286	002472	双环传动	10,800	281,016.00	0.08
287	600600	青岛啤酒	3,700	276,575.00	0.08
288	603218	日月股份	22,100	273,377.00	0.08
289	300837	浙矿股份	8,900	265,843.00	0.08
290	601456	国联证券	24,100	261,244.00	0.08
291	605116	奥锐特	10,100	260,782.00	0.08
292	000860	顺鑫农业	12,200	259,738.00	0.08
293	688200	华峰测控	2,106	258,616.80	0.08
294	002738	中矿资源	6,800	253,708.00	0.08
295	603096	新经典	12,800	251,904.00	0.08
296	603378	亚士创能	29,600	250,416.00	0.07
297	688233	神工股份	7,067	249,394.43	0.07
298	688981	中芯国际	4,623	245,111.46	0.07
299	603909	建发合诚	21,060	239,241.60	0.07
300	688125	安达智能	6,033	238,001.85	0.07
301	000060	中金岭南	54,550	235,656.00	0.07
302	002645	华宏科技	20,800	235,040.00	0.07
303	03690	美团-W	3,160	234,533.36	0.07
304	300682	朗新集团	14,300	234,377.00	0.07
305	688466	金科环境	13,150	233,412.50	0.07
306	300031	宝通科技	12,500	231,750.00	0.07
307	301468	博盈特焊	7,600	231,724.00	0.07
308	688378	奥来德	4,846	229,409.64	0.07
309	688618	三旺通信	3,912	229,243.20	0.07
310	002839	张家港行	58,800	228,144.00	0.07
311	600984	建设机械	58,370	218,887.50	0.07
312	688372	伟测科技	2,689	210,817.60	0.06
313	00839	中教控股	47,000	208,702.47	0.06
314	603379	三美股份	5,900	200,600.00	0.06
315	601636	旗滨集团	28,400	194,256.00	0.06
316	002955	鸿合科技	6,000	193,860.00	0.06
317	600050	中国联通	43,200	189,216.00	0.06
318	603915	国茂股份	11,300	186,224.00	0.06
319	601001	晋控煤业	15,100	186,183.00	0.06
320	688439	振华风光	2,065	184,012.15	0.06
321	688563	航材股份	2,936	179,474.46	0.05
322	688161	威高骨科	4,244	175,913.80	0.05
323	002129	TCL 中环	11,200	175,168.00	0.05
324	301280	珠城科技	4,174	171,467.92	0.05
325	301325	曼恩斯特	2,181	169,114.74	0.05
326	00762	中国联通	38,000	168,738.16	0.05

327	301267	华夏眼科	5,224	167,638.16	0.05
328	601628	中国人寿	5,900	167,265.00	0.05
329	688569	铁科轨道	5,983	165,190.63	0.05
330	300870	欧陆通	3,700	163,799.00	0.05
331	688025	杰普特	1,765	163,350.75	0.05
332	688652	京仪装备	2,710	161,109.50	0.05
333	300601	康泰生物	5,700	154,755.00	0.05
334	600958	东方证券	16,800	146,160.00	0.04
335	02382	舜宇光学科技	2,200	141,252.51	0.04
336	603067	振华股份	13,852	141,151.88	0.04
337	301508	中机认检	4,186	140,801.39	0.04
338	300996	普联软件	6,020	137,858.00	0.04
339	688653	康希通信	6,478	127,078.12	0.04
340	603208	江山欧派	4,160	123,510.40	0.04
341	688478	晶升股份	2,007	104,364.00	0.03
342	601882	海天精工	3,700	96,755.00	0.03
343	603565	中谷物流	11,100	91,353.00	0.03
344	603171	税友股份	2,400	84,912.00	0.03
345	688582	芯动联科	2,062	79,737.54	0.02
346	301232	飞沃科技	1,643	79,669.07	0.02
347	002381	双箭股份	10,400	78,832.00	0.02
348	688623	二元科技	1,066	75,664.68	0.02
349	301559	中集环科	4,006	75,273.54	0.02
350	688479	友车科技	2,820	65,762.40	0.02
351	603611	诺力股份	3,400	64,362.00	0.02
352	301528	多浦乐	878	63,846.38	0.02
353	688450	光格科技	1,662	61,217.74	0.02
354	688112	鼎阳科技	1,402	56,136.08	0.02
355	688719	爱科赛博	854	54,242.36	0.02
356	301510	固高科技	1,396	49,853.96	0.01
357	601825	沪农商行	8,600	49,364.00	0.01
358	688290	景业智能	960	45,859.20	0.01
359	688249	晶合集成	2,505	43,211.25	0.01
360	600480	凌云股份	4,300	39,173.00	0.01
361	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
362	001286	陕西能源	3,767	32,207.85	0.01
363	688308	欧科亿	972	27,118.80	0.01
364	688469	芯联集成	4,734	23,764.68	0.01
365	301526	国际复材	5,158	22,953.10	0.01
366	688472	阿特斯	1,621	20,473.23	0.01
367	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.01
368	301421	波长光电	332	19,710.84	0.01

369	688627	精智达	222	19,473.84	0.01
370	301558	三态股份	1,377	18,451.80	0.01
371	300394	天孚通信	200	18,304.00	0.01
372	688548	广钢气体	1,431	18,245.25	0.01
373	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.01
374	688549	中巨芯	2,074	16,778.66	0.01
375	301509	金凯生科	251	15,619.73	0.00
376	688629	华丰科技	708	15,505.20	0.00
377	688591	泰凌微	522	14,626.44	0.00
378	301362	民爆光电	378	14,560.56	0.00
379	301382	蜂助手	408	14,532.96	0.00
380	688507	索辰科技	101	13,811.75	0.00
381	688576	西山科技	143	13,746.59	0.00
382	688146	中船特气	398	13,535.98	0.00
383	688512	慧智微	660	12,863.40	0.00
384	688531	日联科技	127	12,837.16	0.00
385	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
386	688702	盛科通信	258	12,430.44	0.00
387	688620	安凯微	1,016	12,009.12	0.00
388	301320	豪江智能	642	11,857.74	0.00
389	301393	昊帆生物	193	11,458.41	0.00
390	688631	莱斯信息	321	11,315.25	0.00
391	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
392	301550	斯菱股份	252	10,979.64	0.00
393	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
394	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
395	002131	利欧股份	4,600	10,488.00	0.00
396	301456	盘古智能	344	10,454.16	0.00
397	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
398	301345	涛涛车业	169	10,292.10	0.00
399	601096	宏盛华源	2,511	10,194.66	0.00
400	601061	中信金属	1,320	10,177.20	0.00
401	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
402	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
403	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
404	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
405	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
406	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
407	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
408	301439	泓淋电力	611	8,932.82	0.00
409	301525	儒竞科技	106	8,634.76	0.00
410	301323	新莱福	228	8,433.72	0.00
411	301500	飞南资源	398	8,314.22	0.00

412	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
413	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
414	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
415	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
416	301520	万邦医药	154	8,121.96	0.00
417	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
418	301322	绿通科技	196	8,067.36	0.00
419	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
420	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
421	301371	敷尔佳	207	7,779.06	0.00
422	688612	威迈斯	200	7,594.00	0.00
423	301548	崇德科技	127	7,491.73	0.00
424	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
425	688429	时创能源	346	7,331.74	0.00
426	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
427	301295	美硕科技	215	7,135.85	0.00
428	301388	欣灵电气	292	7,121.88	0.00
429	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
430	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
431	688334	西高院	391	6,776.03	0.00
432	601083	锦江航运	598	6,619.86	0.00
433	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
434	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
435	603004	鼎龙科技	188	5,863.72	0.00
436	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
437	603275	众辰科技	127	5,041.90	0.00
438	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
439	603119	浙江荣泰	202	4,821.74	0.00
440	603107	上海汽配	248	4,511.12	0.00
441	603193	润本股份	248	4,131.68	0.00
442	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
443	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
444	603075	热威股份	153	3,566.43	0.00
445	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
446	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
447	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	600012	皖通高速	4,335,011.00	1.07
2	002517	恺英网络	3,483,705.00	0.86
3	002568	百润股份	3,254,290.00	0.81
4	000333	美的集团	2,958,679.00	0.73
5	601857	中国石油	2,850,362.00	0.71
6	600900	长江电力	2,618,930.00	0.65
7	000928	中钢国际	2,571,770.00	0.64
8	300122	智飞生物	2,510,713.00	0.62
9	600079	人福医药	2,476,871.18	0.61
10	600398	海澜之家	2,394,526.00	0.59
11	002092	中泰化学	2,098,314.00	0.52
12	600827	百联股份	2,087,765.00	0.52
13	300792	壹网壹创	2,041,273.00	0.50
14	600845	宝信软件	2,033,791.20	0.50
15	601567	三星医疗	2,008,138.00	0.50
16	300559	佳发教育	2,005,666.00	0.50
17	600963	岳阳林纸	1,996,633.00	0.49
18	601607	上海医药	1,992,394.03	0.49
19	688737	中自科技	1,946,993.17	0.48
20	300130	新国都	1,939,094.00	0.48

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。

#### 8.4.2 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	600012	皖通高速	3,564,195.00	0.88
2	603681	永冠新材	3,409,458.00	0.84
3	000100	TCL 科技	2,954,483.00	0.73
4	002568	百润股份	2,847,580.00	0.70
5	600057	厦门象屿	2,742,934.00	0.68
6	600827	百联股份	2,624,243.00	0.65
7	300870	欧陆通	2,455,150.64	0.61
8	600028	中国石化	2,438,407.00	0.60
9	600487	亨通光电	2,381,102.00	0.59
10	688039	当虹科技	2,238,406.90	0.55
11	002517	恺英网络	2,199,643.00	0.54
12	603063	禾望电气	2,188,462.00	0.54
13	603067	振华股份	2,173,250.40	0.54
14	002292	奥飞娱乐	2,110,611.00	0.52

15	600079	人福医药	2,075,244.00	0.51
16	600519	贵州茅台	1,976,577.00	0.49
17	300122	智飞生物	1,946,225.00	0.48
18	00700	腾讯控股	1,892,207.26	0.47
19	300559	佳发教育	1,885,318.00	0.47
20	601878	浙商证券	1,849,701.00	0.46

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。

#### 8.4.3 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	339,039,408.82
卖出股票收入（成交）总额	361,793,031.52

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。

#### 8.5 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	11,156,169.86	3.34
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）	2,100,753.68	0.63
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,256,923.54	3.97

#### 8.6 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	019703	23 国债 10	110,000	11,156,169.86	3.34
2	113653	永 22 转债	4,550	495,069.42	0.15
3	110091	合力转债	2,150	308,603.81	0.09
4	113062	常银转债	2,370	257,867.10	0.08
5	111015	东亚转债	1,770	227,070.58	0.07



## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本，以达到降低投资组合整体风险的目的。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	37,036.80
2	应收清算款	38,820,840.85
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,117.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,860,994.70

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113653	永 22 转债	495,069.42	0.15
2	110091	合力转债	308,603.81	0.09
3	113062	常银转债	257,867.10	0.08
4	113060	浙 22 转债	143,872.15	0.04
5	118024	冠宇转债	76,176.84	0.02
6	113655	欧 22 转债	74,751.13	0.02
7	113661	福 22 转债	65,296.11	0.02
8	113669	景 23 转债	64,475.38	0.02
9	111007	永和转债	53,768.34	0.02
10	123145	药石转债	52,787.82	0.02
11	118013	道通转债	49,541.35	0.01
12	111010	立昂转债	49,028.00	0.01
13	123180	浙矿转债	30,842.88	0.01
14	118031	天 23 转债	27,470.27	0.01
15	113059	福莱转债	26,569.42	0.01
16	127077	华宏转债	20,796.21	0.01
17	118027	宏图转债	15,960.66	0.00
18	118019	金盘转债	15,536.07	0.00
19	118026	利元转债	10,844.05	0.00

### 8.12.5 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
南方价值臻选混合 A	4,395	85,035.58	693,127.15	0.19%	373,038,266.40	99.81%
南方价值臻选混合 C	989	20,292.72	-	-	20,069,502.57	100.00%
合计	5,384	73,142.81	693,127.15	0.18%	393,107,768.97	99.82%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	南方价值臻选混合 A	522,108.68	0.1397%
	南方价值臻选混合 C	5,010.93	0.0250%
	合计	527,119.61	0.1339%

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 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	份额级别	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	南方价值臻选混合 A	0
	南方价值臻选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方价值臻选混合 A	0~10
	南方价值臻选混合 C	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方价值臻选混合 A	南方价值臻选混合 C
基金合同生效日(2021 年 6 月 21 日)基金份额总额	1,409,686,126.75	44,583,592.72
本报告期期初基金份额总额	427,947,903.48	21,716,817.50
本报告期基金总申购份额	6,573,672.54	13,986,187.23
减：报告期基金总赎回份额	60,790,182.47	15,633,502.16
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	373,731,393.55	20,069,502.57

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 3 年，本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 50,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
中信建投	2	96,736,950.20	14.08%	88,780.28	14.48%	-
华泰证券	4	90,745,187.22	13.21%	82,208.51	13.41%	-
金元证券	1	81,079,924.14	11.80%	69,274.56	11.30%	-
申万宏源	2	72,146,711.21	10.50%	66,361.00	10.82%	-
中金公司	2	65,147,709.37	9.48%	58,222.37	9.50%	-
国联证券	1	39,902,117.65	5.81%	36,317.32	5.92%	-
中泰证券	2	33,371,695.31	4.86%	30,842.55	5.03%	-
上海证券	1	32,911,736.78	4.79%	30,019.75	4.90%	-
中信证券	5	30,772,655.76	4.48%	28,594.84	4.66%	-
招商证券	4	27,677,017.11	4.03%	22,842.34	3.73%	-
德邦证券	1	21,123,287.23	3.07%	19,398.72	3.16%	-
天风证券	1	18,337,874.56	2.67%	13,722.95	2.24%	-
光大证券	1	14,354,178.69	2.09%	13,341.55	2.18%	-
海通证券	2	13,664,885.81	1.99%	9,965.59	1.63%	-
国金证券	1	12,828,954.31	1.87%	11,832.56	1.93%	-
国海证券	1	12,420,663.10	1.81%	9,985.52	1.63%	-
信达证券	1	7,416,989.43	1.08%	6,941.18	1.13%	-
西南证券	2	6,661,451.65	0.97%	6,136.06	1.00%	-
平安证券	1	2,918,487.56	0.42%	2,681.12	0.44%	-
银河证券	2	2,780,129.80	0.40%	2,027.89	0.33%	-
东北证券	2	1,711,435.85	0.25%	1,576.74	0.26%	-
东吴证券	1	1,367,955.95	0.20%	1,181.53	0.19%	-
方正证券	2	609,217.78	0.09%	570.20	0.09%	-
东方证券	1	343,966.37	0.05%	321.93	0.05%	-
华福证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

国盛证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	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：

长江证券

德邦证券

东北证券

东方证券

方正证券

国海证券

国金证券

国盛证券

国泰君安

国新证券

海通证券

华安证券

华创证券

华福证券

华泰证券

华西证券

瑞银证券

上海证券

西部证券

西南证券

信达证券

兴业证券

银河证券

招商证券

中金公司

中泰证券

中信建投

中信证券

退租交易单元：

国泰君安

招商证券

## 11.7.2 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
中信建投	8,578,930.00	43.34%	125,000,000.00	33.88%	-	-
华泰证券	140,227.73	0.71%	-	-	-	-
金元证券	11,021,670.00	55.69%	63,000,000.00	17.07%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

国联证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	51,770.80	0.26%	40,000,000.00	10.84%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	141,000,000.00	38.21%	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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	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	2023-02-16
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	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	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	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	2023-03-02
4	南方基金关于旗下部分基金增加泰信财富为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-03-03
5	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	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	2023-03-22
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	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	2023-03-23
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	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	2023-04-15
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	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	2023-04-29
9	南方基金关于旗下部分基金增加招商证券为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-05-09
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	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	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	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	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	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	2023-06-15
13	南方基金关于旗下部分基金增加中欧财富为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-06-16
14	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	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	2023-06-21
15	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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会	2023-07-08

		会基金电子披露网站	
16	南方基金关于旗下部分基金增加浙商证券为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-07-12
17	南方基金关于旗下部分基金增加上海证券为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-07-21
18	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	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	2023-07-21
19	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	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	2023-08-03
20	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	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	2023-08-18
21	南方基金管理股份有限公司关于运用自有资金投资旗下基金的公告	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	2023-08-21
22	南方基金关于旗下部分基金增加杭州银行为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-08-31
23	南方基金管理股份有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	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	2023-09-07
24	南方基金管理股份有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	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	2023-09-07
25	南方基金管理股份有限公司关于运用自有资金投资旗下权益类公募基金的公告	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	2023-11-03
26	南方基金关于旗下部分基金增加微众银行为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-11-08
27	南方基金关于旗下部分基金增加江苏银行为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-11-17
28	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	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	2023-12-01
29	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	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	2023-12-13
30	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠	上海证券报、基金管	2023-12-15

	的公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
31	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方华泰联合证券承销证券的关联交易公告	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	2023-12-23
32	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方兴业证券承销证券的关联交易公告	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	2023-12-23
33	南方基金关于旗下部分基金增加博时财富为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-12-26

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方价值臻选混合型证券投资基金的文件；
- 2、《南方价值臻选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方价值臻选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、《南方价值臻选混合型证券投资基金 2023 年年度报告》原文。

### 13.2 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。

### 13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>

