

# 中国梦灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

# 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	10
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	39

7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	39
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12	投资组合报告附注.....	40
§8	基金份额持有人信息.....	41
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	41
§9	开放式基金份额变动.....	41
§10	重大事件揭示.....	42
10.1	基金份额持有人大会决议.....	42
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4	基金投资策略的改变.....	42
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8	其他重大事件.....	44
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	44
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	44
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	44
§12	备查文件目录.....	45
12.1	备查文件目录.....	45
12.2	存放地点.....	45
12.3	查阅方式.....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中国梦灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	南方中国梦灵活配置混合
基金主代码	000554
交易代码	000554
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 6 月 9 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	78,681,552.81 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以上市公司基本面研究作为基础，通过专业化研究分析，积极挖掘成长性行业和企业所蕴含的投资机会，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	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
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	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,506,672.25
本期利润	5,927,951.34
加权平均基金份额本期利润	0.0803
本期加权平均净值利润率	3.55%
本期基金份额净值增长率	3.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	92,630,870.52
期末可供分配基金份额利润	1.1772
期末基金资产净值	179,646,673.74
期末基金份额净值	2.283
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	128.30%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.10%	0.84%	0.88%	0.52%	1.22%	0.32%
过去三个月	0.26%	0.77%	-2.53%	0.49%	2.79%	0.28%
过去六个月	3.96%	0.79%	0.50%	0.51%	3.46%	0.28%
过去一年	-0.04%	0.97%	-7.25%	0.59%	7.21%	0.38%
过去三年	37.86%	1.34%	0.67%	0.72%	37.19%	0.62%
自基金合同生效起至今	128.30%	1.50%	73.43%	0.85%	54.87%	0.65%

#### 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

南方中国梦灵活配置混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张延闽	本基金基金经理	2020 年 5 月 29 日	-	13 年	哈尔滨工业大学控制科学与工程硕士，具有基金从业资格。曾就职于融通基金管理有限公司，历任研究员、基金经理、权益投资部总经理。2014 年 10 月 25 日至 2016 年 8 月 11 日，任基金通乾基金经理；2015 年 1 月 16 日至 2019 年 4 月 12 日，任融通转型三动力灵活配置混合基金经理；2016 年 8 月 12 日至 2020 年 1 月 2 日，任融通通乾研究精选混合基金经理；2017 年 2 月 17 日至 2020 年 1 月 2 日，任融通新蓝筹混合基金经理；2018 年 2 月 11 日至 2019 年 11 月 30 日，任融通逆向策略灵活配置混合基金经理；2018 年 12 月 5 日至 2019 年 12 月 11 日，任融通研究优选混合基金经理。2020 年 1 月加入南方基金，现任权益投资部总经理。2020 年 5 月 29 日至今，任南方积配、南方中国梦基金经理；2021 年 8 月 20 日至今，任南方高增基金经理；2022 年 11 月 11 日至今，任南方优势产业混合基金经理；2022 年 11 月 21 日至今，兼任投资经理；2023 年 3 月 17 日至今，任南方



					阿尔法混合基金经理。
--	--	--	--	--	------------

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 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
张延闽	公募基金	5	7,744,741,091.23	2014年10月25日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	-	-	-
	合计	5	7,744,741,091.23	-

#### 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 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，本基金收益率为 3.93%，同期沪深 300，上证综指，深证成指，万得全 A 收益率分别为-0.75%，3.65%，0.1%，3.06%。上半年市场表现较好的板块主要集中在 TMT 板块，指数收益率都超过 10%。表现较差的风格指数是基金重仓股指数，收益率为-3.26%。上半年本基金表现和宽基指数接近，由于没有取得显著的绝对收益，因此当期的投资获得感不强。

回顾市场走势，上半年主要的涨幅发生在 1 月份，年初市场对疫情结束之后的经济复苏和政策力度都抱有较高的期待。然而随着春节后地产销售数据逐月走弱，市场从“强预期”回归“真现实”，陆续回吐年初超前交易的部分。进入 5，6 月份，投资者对下半年经济预期过于谨慎，反映在一大批股票的交易定价甚至低于去年同期水平。我们认为这种状态持续时间不会太长，市场处于赔率和胜率非常具有吸引力的位置。

如果反思上半年基金持仓的表现，我们在去年四季度开始的“赔率优先，市值下沉”选股策略基本正确，但是在行业选择上犯了一些错误。上半年本基金没有主动参与热门板块的炒作，但是前期布局的个股也变相沾了市场短期概念的光，比如 AI，中特估，汇率升值等等。说实话这些因素完全不是我们当初买入这些公司的主要理由，因此在动态估值评估的时候我们会有清醒的认识。在行业层面，我们去年对弱宏观周期的军工和疫情后复苏板块（消费、化工、建材）抱有非常乐观的期待，回过头来看这种认识出现比较大的偏差。军工行业的景气度和竞争格局都出现了瑕疵，相关企业杀估值的幅度也远超想象。另一方面，疫情后复苏的版块在 2023 年也没有如期表现出应有的业绩弹性。虽然我们已经考虑到了居民消费的弹性和持续性可能不如以往周期的强度，但是地产和汽车销售的走弱斜率仍然超出年初预期。这一部分头寸我们认为随着下半年政策转向，股票的边际表现可能会有所好转。对于行业选择的偏差，充分说明了公募基金实践组合投资的重要性。在大多数时候基金经理对未来自上而下的判断胜率其实并不高，实际投资策略中宏观层面灵活应对的价值远远大于买定离手式的预判。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 2.283 元，报告期内，份额净值增长率为 3.96%，同期业绩基准增长率为 0.50%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们对市场持积极乐观态度。即便没有政策强刺激，当前的经济运行状态也好于疫情期间。虽然全球经济发展面临着诸多挑战，然而弱复苏也是复苏，情绪犹豫不决的时候往往又是中期的买点。目前 A 股的整体股息率约为 3.2%，根据我们测算并回溯，在这

个水平下权益资产持有两年以上赚钱的胜率非常高。因此我们的基金将保持较高仓位，不在仓位上择时赌“极端天气”，专心挖掘赔率更高的中长期资产。

最后本基金采用偏逆向投资的策略，从过去三年基金经理管理的组合实践结果来看，这种方法获得了良好的超额回报。未来我们管理的所有产品将在契约范围内采用类似的逆向选股思路。随着产品数目增多，我们希望规模增长的同时能够继续保持该策略的有效性。投资策略扩容意味着对投资储备库的数量和质量要求更高。我们深刻意识到只有不停的迭代，提高资产判断的前瞻性，才能让自己的能力圈跟上规模的扩张。从事基金研究的同事告诉我说，基金经理每年排名前 30% 的最长记录是 5 年，每年排名前 50% 的最长记录是 10 年。虽然投资的前路充满了挑战，但是我们有信心做和时间赛跑的人。再次感谢大家的托付与信任！

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中国梦灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	17,462,831.59	3,441,300.85
结算备付金		146,020.45	213,849.57
存出保证金		42,859.34	46,628.11
交易性金融资产	6.4.3.2	162,552,393.71	146,725,116.42
其中：股票投资		154,329,898.55	139,340,773.91
基金投资		-	-
债券投资		8,222,495.16	7,384,342.51
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		12,861.47	54,847.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		180,216,966.56	150,481,741.98
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2.22	-
应付赎回款		128,792.20	11,453.38
应付管理人报酬		216,248.38	210,960.81
应付托管费		36,041.39	35,160.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	2.09
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	189,208.29	335,397.12
负债合计		570,292.82	592,973.55
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	78,681,552.81	68,269,409.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	100,965,120.93	81,619,359.43
净资产合计		179,646,673.74	149,888,768.43
负债和净资产总计		180,216,966.56	150,481,741.98

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.283 元，基金份额总额 78,681,552.81 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中国梦灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,477,561.95	-10,128,051.78
1.利息收入		36,313.94	46,214.57
其中：存款利息收入	6.4.3.9	36,313.94	29,380.99
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		-	16,833.58
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		2,980,849.79	-379,457.68
其中：股票投资收益	6.4.3.10	2,089,343.56	-1,373,852.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	132,626.77	41,255.07
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.12	-	-
股利收益	6.4.3.13	758,879.46	953,139.63
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.3.14	4,421,279.09	-9,813,041.13
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.3.15	39,119.13	18,232.46
减：二、营业总支出		1,549,610.61	1,340,502.60
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	1,239,472.71	1,060,540.33
2.托管费	6.4.6.2.2	206,578.77	176,756.71
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-

6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		0.87	-
8.其他费用	6.4.3.16	103,558.26	103,205.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,927,951.34	-11,468,554.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,927,951.34	-11,468,554.38
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,927,951.34	-11,468,554.38

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中国梦灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	68,269,409.00	-	81,619,359.43	149,888,768.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	68,269,409.00	-	81,619,359.43	149,888,768.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,412,143.81	-	19,345,761.50	29,757,905.31
（一）、综合收益总额	-	-	5,927,951.34	5,927,951.34
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	10,412,143.81	-	13,417,810.16	23,829,953.97
其中：1.基金申购款	17,089,496.78	-	21,872,953.10	38,962,449.88
2.基金赎回款	-6,677,352.97	-	-8,455,142.94	-15,132,495.91
（三）、本期向基	-	-	-	-

金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	78,681,552.81	-	100,965,120.93	179,646,673.74
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	62,391,061.13	-	91,722,932.24	154,113,993.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	62,391,061.13	-	91,722,932.24	154,113,993.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,690,873.02	-	-8,144,029.54	-5,453,156.52
（一）、综合收益总额	-	-	-11,468,554.38	-11,468,554.38
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,690,873.02	-	3,324,524.84	6,015,397.86
其中：1.基金申购款	7,441,466.69	-	9,051,388.41	16,492,855.10
2.基金赎回款	-4,750,593.67	-	-5,726,863.57	-10,477,457.24
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-



四、本期期末净资产(基金净值)	65,081,934.15	-	83,578,902.70	148,660,836.85
-----------------	---------------	---	---------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	17,462,831.59
等于：本金	17,461,305.78
加：应计利息	1,525.81
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	17,462,831.59

### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	151,415,406.41	-	154,329,898.55	2,914,492.14
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	144,724.86	8,222,495.16	23,999.30
	银行间市场	-	-	-
	合计	144,724.86	8,222,495.16	23,999.30
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	159,469,177.41	144,724.86	162,552,393.71	2,938,491.44

### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

### 6.4.3.4 买入返售金融资产

#### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

#### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.3.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	231.69
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	104,674.04

其中：交易所市场	104,674.04
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
其他	-
合计	189,208.29

#### 6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	68,269,409.00	68,269,409.00
本期申购	17,089,496.78	17,089,496.78
本期赎回（以“-”号填列）	-6,677,352.97	-6,677,352.97
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	78,681,552.81	78,681,552.81

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	79,271,415.54	2,347,943.89	81,619,359.43
本期利润	1,506,672.25	4,421,279.09	5,927,951.34
本期基金份额交易产生的变动数	11,852,782.73	1,565,027.43	13,417,810.16
其中：基金申购款	19,510,947.37	2,362,005.73	21,872,953.10
基金赎回款	-7,658,164.64	-796,978.30	-8,455,142.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	92,630,870.52	8,334,250.41	100,965,120.93

#### 6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	34,265.87
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	1,581.87
其他	466.20
合计	36,313.94

### 6.4.3.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	115,746,935.56
减：卖出股票成本总额	113,303,191.40
减：交易费用	354,400.60
买卖股票差价收入	2,089,343.56

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

### 6.4.3.11 债券投资收益

#### 6.4.3.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	55,698.80
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	76,927.97
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	132,626.77

#### 6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,347,000.17
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,124,071.70
减：应计利息总额	145,989.69
减：交易费用	10.81
买卖债券差价收入	76,927.97

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

### 6.4.3.12 衍生工具收益

#### 6.4.3.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

#### 6.4.3.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

### 6.4.3.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	758,879.46
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	758,879.46

#### 6.4.3.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	4,421,279.09
——股票投资	4,450,490.49
——债券投资	-29,211.40
——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	4,421,279.09

#### 6.4.3.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	29,693.18
基金转换费收入	9,425.95
合计	39,119.13

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	356.00

其他	299.70
合计	103,558.26

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

无。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

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

#### 6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	8,065,215.00	3.39%	-	-
兴业证券	-	-	118,664,526.19	17.92%

###### 6.4.6.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	7,430.48	3.39%	1,958.03	1.87%
兴业证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	-	-	-	-
兴业证券	108,138.87	17.83%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

### 6.4.6.2 关联方报酬

#### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,239,472.71	1,060,540.33
其中：支付销售机构的客户维护费	330,593.87	279,835.62

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

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	206,578.77	176,756.71

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

#### 6.4.6.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

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

无。

#### 6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	17,462,831.59	34,265.87	6,302,486.22	24,990.51

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

#### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	1,845	59,999.40
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	2,811	58,806.12



兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	网下申购	19,457	110,710.33
-----------	--------	------	------	--------	------------

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	885	71,508.00

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688515	裕太微	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期	92.00	162.75	777	71,484.00	126,456.75	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	869	47,795.00	47,795.00	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁定期	19.86	18.06	1,025	20,356.50	18,511.50	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期	23.60	64.67	170	4,012.00	10,993.90	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定期	5.69	5.41	1,946	11,072.74	10,527.86	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期	37.88	29.49	330	12,500.40	9,731.70	-
688629	华丰科技	2023	6 个月	新股锁	9.26	18.59	491	4,546.66	9,127.69	-

		年 6 月 16 日		定期						
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	32.52	42.37	185	6,016.20	7,838.45	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	12.68	22.31	337	4,273.16	7,518.47	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	26.74	40.68	184	4,920.16	7,485.12	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	10.68	12.34	533	5,692.44	6,577.22	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	75.00	90.76	67	5,025.00	6,080.92	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	36.15	38.13	156	5,639.40	5,948.28	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	14.16	16.21	365	5,168.40	5,916.65	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	43.67	53.05	110	4,803.70	5,835.50	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	12.10	12.07	473	5,723.30	5,709.11	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	30.26	25.33	216	6,536.16	5,471.28	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	20.92	19.16	282	5,899.44	5,403.12	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	35.00	51.23	97	3,395.00	4,969.31	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁 定期	26.66	31.50	149	3,972.34	4,693.50	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	25.28	29.87	145	3,665.60	4,331.15	-

688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	125.8 8	86.79	48	6,042.24	4,165.92	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	6.58	7.58	510	3,355.80	3,865.80	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	33.99	29.49	119	4,044.81	3,509.31	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	11.66	12.26	167	1,947.22	2,047.42	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	10.36	11.84	172	1,781.92	2,036.48	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	25.98	24.53	56	1,454.88	1,373.68	-

#### 6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

证券代 码	证券名称	成功认 购日	受限期	流通受 限类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 (单位 张)	期末成本总 额	期末估值总 额	备 注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，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。

#### 6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

#### 6.4.9.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 6.4.9.4 市场风险

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

##### 6.4.9.4.1 利率风险

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

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

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

#### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,462,831.59	-	-	-	17,462,831.59
结算备付金	146,020.45	-	-	-	146,020.45
存出保证金	42,859.34	-	-	-	42,859.34
交易性金融资产	8,143,831.23	-	78,663.93	154,329,898.55	162,552,393.71
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	1,520.00	-	-	11,341.47	12,861.47
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	25,797,062.61	-	78,663.93	154,341,240.02	180,216,966.56
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	-	-	-	2.22	2.22
应付赎回款	-	-	-	128,792.20	128,792.20
应付管理人报酬	-	-	-	216,248.38	216,248.38
应付托管费	-	-	-	36,041.39	36,041.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	189,208.29	189,208.29
负债总计	-	-	-	570,292.82	570,292.82
利率敏感度缺口	25,797,062.61	-	78,663.93	153,770,947.20	179,646,673.74
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,441,300.85	-	-	-	3,441,300.85
结算备付金	213,849.57	-	-	-	213,849.57
存出保证金	46,628.11	-	-	-	46,628.11
交易性金融资产	7,081,274.76	-	303,067.75	139,340,773.91	146,725,116.42
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	10,781.00	-	-	44,066.03	54,847.03
递延所得税	-	-	-	-	-

资产					
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,793,834.29	-	303,067.75	139,384,839.94	150,481,741.98
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	11,453.38	11,453.38
应付管理人报酬	-	-	-	210,960.81	210,960.81
应付托管费	-	-	-	35,160.15	35,160.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2.09	2.09
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	335,397.12	335,397.12
负债总计	-	-	-	592,973.55	592,973.55
利率敏感度缺口	10,793,834.29	-	303,067.75	138,791,866.39	149,888,768.43

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

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-1,823.97	-5,048.92
2.市场利率平行下降25个基点	1,841.73	5,125.37	

#### 6.4.9.4.2 外汇风险



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

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例范围 0-95%；债券、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)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	154,329,898.55	85.91	139,340,773.91	92.96
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	154,329,898.55	85.91	139,340,773.91	92.96

##### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单

	位：人民币元)	
	本期末( 2023 年 6 月 30 日 )	上年度末( 2022 年 12 月 31 日 )
1.沪深 300 上升 5%	4,520,164.76	4,983,176.35
2.沪深 300 下降 5%	-4,520,164.76	-4,983,176.35

## 6.4.10 公允价值

### 6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	154,072,673.53
第二层次	8,191,626.23
第三层次	288,093.95
合计	162,552,393.71

#### 6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

#### 6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	154,329,898.55	85.64
	其中：股票	154,329,898.55	85.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,222,495.16	4.56
	其中：债券	8,222,495.16	4.56
	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	17,608,852.04	9.77
8	其他资产	55,720.81	0.03
9	合计	180,216,966.56	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,538,920.00	1.97
B	采矿业	-	-
C	制造业	124,755,584.96	69.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,731,480.00	0.96
E	建筑业	2,047.42	0.00
F	批发和零售业	999,436.80	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	275,432.40	0.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,185,435.55	6.23
J	金融业	-	-
K	房地产业	10,307,673.00	5.74
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,930.82	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,512,957.60	0.84
S	综合	-	-
	合计	154,329,898.55	85.91

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688333	铂力特	132,170	13,975,655.80	7.78
2	600150	中国船舶	320,600	10,550,946.00	5.87
3	600685	中船防务	333,527	9,989,133.65	5.56
4	001979	招商蛇口	659,700	8,595,891.00	4.78
5	603927	中科软	211,760	8,165,465.60	4.55
6	603960	克来机电	435,700	8,125,805.00	4.52
7	300833	浩洋股份	67,500	7,386,525.00	4.11
8	002991	甘源食品	91,700	7,033,390.00	3.92
9	688281	华秦科技	28,844	5,840,910.00	3.25
10	603087	甘李药业	141,600	5,451,600.00	3.03
11	300633	开立医疗	86,194	4,697,573.00	2.61
12	600572	康恩贝	678,200	4,645,670.00	2.59
13	688981	中芯国际	84,193	4,253,430.36	2.37
14	002049	紫光国微	44,618	4,160,628.50	2.32
15	603181	皇马科技	341,869	3,808,420.66	2.12
16	600085	同仁堂	65,100	3,747,156.00	2.09
17	002299	圣农发展	184,800	3,538,920.00	1.97
18	600482	中国动力	144,600	3,389,424.00	1.89
19	689009	九号公司	80,991	2,984,518.35	1.66
20	002773	康弘药业	149,000	2,848,880.00	1.59
21	301327	华宝新能	35,354	2,796,854.94	1.56
22	601890	亚星锚链	204,900	2,372,742.00	1.32
23	603039	泛微网络	24,722	2,018,056.86	1.12
24	688677	海泰新光	35,207	1,997,645.18	1.11
25	601985	中国核电	245,600	1,731,480.00	0.96
26	000031	大悦城	467,700	1,711,782.00	0.95
27	688006	杭可科技	55,784	1,699,738.48	0.95
28	002853	皮阿诺	96,100	1,662,530.00	0.93
29	688211	中科微至	36,057	1,628,694.69	0.91

30	300737	科顺股份	172,200	1,577,352.00	0.88
31	603833	欧派家居	16,000	1,532,800.00	0.85
32	300860	锋尚文化	27,290	1,512,957.60	0.84
33	688323	瑞华泰	40,134	960,807.96	0.53
34	688066	航天宏图	15,504	944,193.60	0.53
35	000786	北新建材	34,800	852,948.00	0.47
36	688383	新益昌	5,825	810,956.50	0.45
37	688433	华曙高科	19,050	647,327.50	0.36
38	301166	优宁维	14,400	618,336.00	0.34
39	002847	盐津铺子	6,600	561,330.00	0.31
40	605077	华康股份	16,940	448,571.20	0.25
41	688696	极米科技	3,157	440,054.23	0.24
42	688772	珠海冠宇	21,075	424,661.25	0.24
43	605266	健之佳	4,500	377,235.00	0.21
44	002025	航天电器	4,900	312,620.00	0.17
45	603565	中谷物流	25,503	275,432.40	0.15
46	688793	倍轻松	3,958	213,336.20	0.12
47	688020	方邦股份	3,317	165,750.49	0.09
48	688515	裕太微	777	126,456.75	0.07
49	688629	华丰科技	4,906	111,643.99	0.06
50	688443	智翔金泰	3,292	101,287.12	0.06
51	688582	芯动联科	1,840	85,068.72	0.05
52	601208	东材科技	5,640	71,628.00	0.04
53	688620	安凯微	5,323	70,859.02	0.04
54	688603	天承科技	869	47,795.00	0.03
55	688631	莱斯信息	1,446	46,691.71	0.03
56	688623	双元科技	473	43,210.67	0.02
57	688249	晶合集成	1,025	18,511.50	0.01
58	301297	富乐德	667	15,014.17	0.01
59	688361	中科飞测	170	10,993.90	0.01
60	688469	中芯集成	1,946	10,527.86	0.01
61	688478	晶升股份	185	7,838.45	0.00
62	688562	航天软件	337	7,518.47	0.00
63	301280	珠城科技	192	6,865.92	0.00
64	688458	美芯晟	67	6,080.92	0.00
65	688146	中船特气	156	5,948.28	0.00
66	688334	西高院	365	5,916.65	0.00
67	688543	国科军工	110	5,835.50	0.00
68	688352	硕中科技	473	5,709.11	0.00
69	688570	天玛智控	216	5,471.28	0.00
70	688512	慧智微	282	5,403.12	0.00
71	688535	华海诚科	97	4,969.31	0.00
72	601061	中信金属	510	3,865.80	0.00

73	688479	友车科技	119	3,509.31	0.00
74	601133	柏诚股份	167	2,047.42	0.00
75	601065	江盐集团	172	2,036.48	0.00
76	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
77	603125	常青科技	56	1,373.68	0.00
78	603067	振华股份	100	1,215.00	0.00
79	688390	固德威	3	500.58	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	001979	招商蛇口	9,193,338.00	6.13
2	600085	同仁堂	8,460,810.00	5.64
3	600572	康恩贝	6,996,407.00	4.67
4	002049	紫光国微	6,071,878.00	4.05
5	603087	甘李药业	5,977,764.00	3.99
6	603927	中科软	5,548,685.83	3.70
7	688981	中芯国际	5,294,426.86	3.53
8	600150	中国船舶	4,435,417.00	2.96
9	600685	中船防务	4,089,313.70	2.73
10	301327	华宝新能	4,005,851.03	2.67
11	689009	九号公司	3,512,251.44	2.34
12	600030	中信证券	3,439,453.83	2.29
13	300633	开立医疗	3,057,701.00	2.04
14	000063	中兴通讯	2,986,921.00	1.99
15	002773	康弘药业	2,883,323.00	1.92
16	600482	中国动力	2,842,395.00	1.90
17	601555	东吴证券	2,574,207.00	1.72
18	002299	圣农发展	2,466,324.00	1.65
19	300860	锋尚文化	2,426,534.00	1.62
20	601890	亚星锚链	2,253,545.00	1.50

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002049	紫光国微	11,255,425.00	7.51
2	000733	振华科技	8,452,378.88	5.64

3	603927	中科软	8,050,427.60	5.37
4	600685	中船防务	7,338,262.46	4.90
5	600150	中国船舶	5,635,123.60	3.76
6	600085	同仁堂	5,161,606.00	3.44
7	603288	海天味业	4,248,922.00	2.83
8	002847	盐津铺子	3,486,467.00	2.33
9	603885	吉祥航空	3,465,137.00	2.31
10	000063	中兴通讯	3,339,703.00	2.23
11	600572	康恩贝	3,267,366.00	2.18
12	300699	光威复材	3,225,856.00	2.15
13	600030	中信证券	3,219,281.00	2.15
14	603565	中谷物流	2,899,225.00	1.93
15	601555	东吴证券	2,573,105.00	1.72
16	603181	皇马科技	2,349,105.00	1.57
17	002025	航天电器	1,839,901.00	1.23
18	002299	圣农发展	1,752,104.00	1.17
19	688777	中控技术	1,699,401.00	1.13
20	688012	中微公司	1,667,457.83	1.11

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	123,841,825.55
卖出股票收入（成交）总额	115,746,935.56

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	8,143,831.23	4.53
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）	78,663.93	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	8,222,495.16	4.58
----	----	--------------	------

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019679	22 国债 14	80,000	8,143,831.23	4.53
2	118018	瑞科转债	550	63,936.93	0.04
3	113064	东材转债	90	12,044.63	0.01
4	118027	宏图转债	20	2,682.37	0.00

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。



## 7.12 投资组合报告附注

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

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

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

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	42,859.34
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,861.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,720.81

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	118018	瑞科转债	63,936.93	0.04
2	113064	东材转债	12,044.63	0.01
3	118027	宏图转债	2,682.37	0.00

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
14,613	5,384.35	12,172,069.32	15.47%	66,509,483.49	84.53%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	393,050.47	0.4995%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年6月9日)基金份额总额	1,194,190,882.26
本报告期期初基金份额总额	68,269,409.00
本报告期基金总申购份额	17,089,496.78
减：报告期基金总赎回份额	6,677,352.97
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	78,681,552.81

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
金元证券	1	78,792,493.60	33.14%	72,635.57	33.15%	-
海通证券	2	67,778,228.10	28.50%	62,454.29	28.50%	-
中信建投	1	66,314,762.50	27.89%	61,096.51	27.88%	-
安信证券	1	9,430,481.37	3.97%	8,689.09	3.97%	-
华泰证券	2	8,065,215.00	3.39%	7,430.48	3.39%	-
西南证券	1	7,078,142.76	2.98%	6,525.03	2.98%	-
东兴证券	1	330,236.00	0.14%	304.15	0.14%	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

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

A: 选择标准

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

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

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

C: 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

新增交易单元:

无

退租交易单元:

无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
金元证券	260,239.17	3.16%	-	-	-	-
海通证券	7,987,771.00	96.84%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-15
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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-29
3	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-10
4	南方基金关于旗下部分基金增加青岛农商银行作为销售机构及开通相关业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-02

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立中国梦灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《中国梦灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中国梦灵活配置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、《中国梦灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告》原文。

## 12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

## 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>