

南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 2021 年中期报告

2021 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：2021 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 2021 年 8 月 27 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
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.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 本报告期投资基金情况	50
7.13 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	58
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.9 其他重大事件	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)	
基金简称	南方养老目标日期 2035(FOF)	
基金主代码	006290	
交易代码	006290	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 6 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	751,238,298.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方养老目标日期 2035(FOF)A	南方养老目标日期 2035(FOF)C
下属分级基金的交易代码	006290	006291
报告期末下属分级基金的份 额总额	667,337,745.98 份	83,900,552.45 份

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方养老目标日期 2035 (FOF)”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金是采用目标日期策略的基金中基金，目标日期为 2035 年 12 月 31 日。本基金通过大类资产配置，投资于多种具有不同风险收益特征的基金，并随着目标日期的临近逐步降低本基金整体的风险收益水平，以寻求基金资产的长期稳健增值。目标日期到达后，本基金将在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金力争通过合理判断市场走势，合理配置基金、股票、债券等投资工具的比例，通过定量和定性相结合的方法精选具有不同风险收益特征的基金，力争实现基金资产的稳定回报。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准： $X * \text{沪深 300 指数收益率} + (100\% - X) * \text{上证国债指数收益率}$ 。基金合同生效之日至 2023.12.31，权益类资产比例 35%-60%，X 为 50%；2024.1.1-2027.12.31，权益类资产比例 25%-50%，X 为 40%；2028.1.1-2031.12.31，权益类资产比例 15%-40%，X 为 30%；2032.1.1-2035.12.31，权益类资产比例 5%-30%，X 为 20%；2036.1.1 起，权益类资产比例 0-30%，X 为 15%。
风险收益特征	本基金属于目标日期型基金中基金，2035 年 12 月 31 日为本基金的目标日期。从建仓期结束起至目标日期止，本基金的风险与收益水平将随着时间的流逝逐步降低。即本基金初始投资阶段的风险收益水平接近一般的混合型基金，随着目标日期的临近，本基金逐步发展为低风险混合型

	基金中基金。目标日期到达后，本基金相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小，但高于债券型基金和货币市场基金。
--	---

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	杨小松（代为履行法定代表人职责）	陈四清

注：因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务（包括代为履行公司法定代表人职责以及法定、公司章程和制度规定的公司董事长其他各项职责）。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
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

1、南方养老目标日期 2035 (FOF)A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	19,630,914.11
本期利润	63,304,355.70
加权平均基金份额本期利润	0.0996
本期加权平均净值利润率	6.25%
本期基金份额净值增长率	6.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	225,176,336.61
期末可供分配基金份额利润	0.3374
期末基金资产净值	1,104,313,290.64
期末基金份额净值	1.6548
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	65.48%

2、南方养老目标日期 2035 (FOF)C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,218,547.69
本期利润	7,746,511.16
加权平均基金份额本期利润	0.0957
本期加权平均净值利润率	6.06%
本期基金份额净值增长率	6.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	27,042,593.49
期末可供分配基金份额利润	0.3223
期末基金资产净值	137,377,299.09
期末基金份额净值	1.6374
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	63.74%

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。

4、本基金 T 日的基金份额净值在所投资基金披露净值或万份收益的当日（法定节假日顺延至第一个交易日）计算，并于 T+3 日公告。

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

南方养老目标日期 2035 (FOF) A

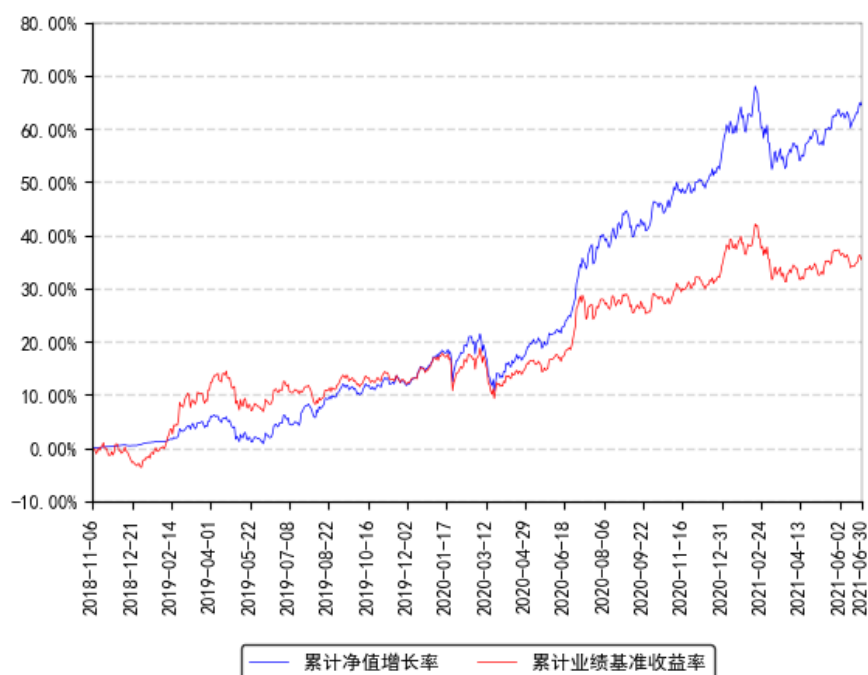
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	1.24%	0.49%	-0.94%	0.41%	2.18%	0.08%
过去三个月	6.48%	0.52%	2.23%	0.49%	4.25%	0.03%
过去六个月	6.39%	0.77%	1.21%	0.66%	5.18%	0.11%
过去一年	31.68%	0.74%	13.98%	0.67%	17.70%	0.07%
自基金合同 生效起至今	65.48%	0.63%	35.89%	0.66%	29.59%	-0.03%

南方养老目标日期 2035 (FOF) C

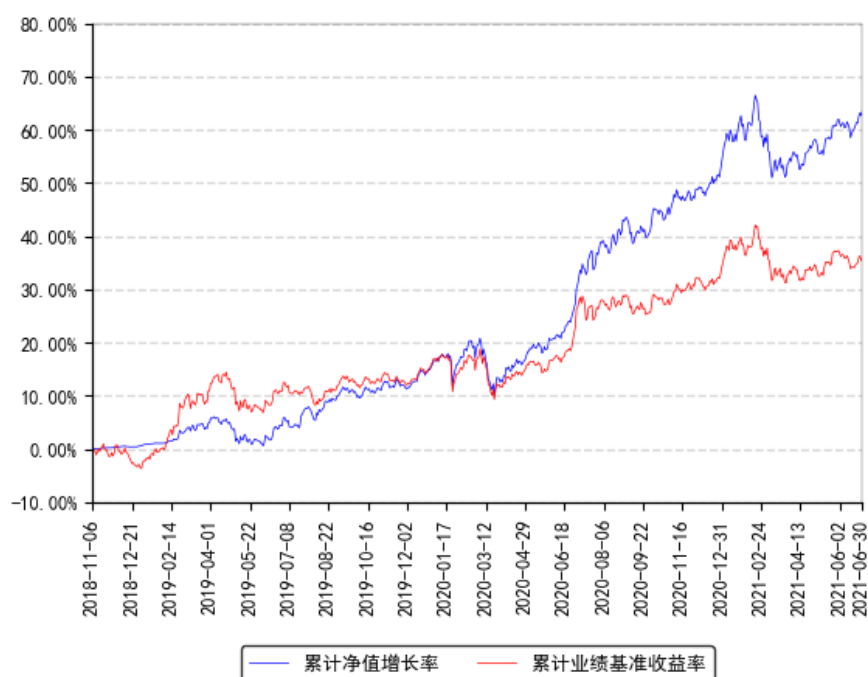
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	1.21%	0.49%	-0.94%	0.41%	2.15%	0.08%
过去三个月	6.37%	0.52%	2.23%	0.49%	4.14%	0.03%
过去六个月	6.18%	0.77%	1.21%	0.66%	4.97%	0.11%
过去一年	31.16%	0.74%	13.98%	0.67%	17.18%	0.07%
自基金合同 生效起至今	63.74%	0.63%	35.89%	0.66%	27.85%	-0.03%

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

南方养老目标日期2035 (F0F) 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



南方养老目标日期2035 (F0F) 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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙) 2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙) 2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙) 2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙) 2.20%。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至本报告期末，南方基金管理股份有限公司(不含子公司)管理资产规模超过 1.4 万亿元，旗下管理 245 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄俊	本基金 基金经 理	2018 年 11 月 6 日	-	11 年	中国人民银行研究生部金融学硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于中国期货保证金监控中心、瀚信资产管理有限公司、深圳盈泰投资管理有限公司，2012 年 5 月加入南方基金，任研究部研究员，负责宏观、策略的研究；2015 年 2 月 26 日至 2015 年 11 月 2 日，任南方隆元、南方中国梦基金经理助理；2015 年 11 月 2 日至 2018 年 2 月 9 日，任南方消费活力基金经理；2018 年 11 月 6 日至今，任南方养老 2035 基金经理；2019 年 5 月 10 日至今，任南方富元稳健养老基金经理；2020 年 7 月 22 日至今，任南方养老 2045 基金经理。
鲁炳良	本基金 基金经 理	2018 年 12 月 21 日	-	10 年	上海财经大学经济学硕士，具有基金从业资格。曾就职于建设银行、申银万国证券研究所、中国平安人寿保险投资管理中心，历任产品经理、基金产品分析

					师、投资经理等。2018 年 6 月加入南方基金；2018 年 12 月 21 日至今，任南方养老 2035 基金经理；2019 年 12 月 3 日至今，任南方养老 2030 基金经理；2020 年 7 月 29 日至今，任南方养老 2040 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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 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

在运作中，本基金按养老目标日期基金的下滑曲线进行大类资产配置，有效控制组合权益暴露风险，期望能够让持有人获得长期稳健的投资回报。在权益持仓结构上，本基金报告期内采取相对均衡的配置策略；债券资产部分主要关注债券基金的信用风险控制能力。子基金选择方面，我们会依旧重点投资于历史业绩优秀、风格清晰的子基金。如果市场情绪过于极端，我们会根据市场状况对投资组合适当再平衡。

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 1.6548 元，报告期内，份额净值增长率为 6.39%，同期业绩基准增长率为 1.21%；本基金 C 份额净值为 1.6374 元，报告期内，份额净值增长率为 6.18%，同期业绩基准增长率为 1.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾上半年，全球疫情开始得到明显控制，海外经济复苏态势明显。受经济复苏、市场乐观情绪及新发基金大量年初发行等因素的影响，春节前国内 A 股与港股均出现上涨，但春节期间美债收益率快速大幅上行，引发市场对高估值板块担忧，导致过去两年涨幅较大的优质成长股在春节后一个月内大幅下跌，而顺周期和低估值板块表现抗跌。进入二季度，市场主要指数呈现震荡态势，结构性行情特征突出，新能源车、芯片、医药等行业和主题在二季度涨幅靠前。债券市场方面，经济复苏进入了相对平稳期，通胀短期高点已经出现。下半年的关注点主要是全球经济的复苏和出口份额的减少对出口增速的影响。目前来看，出口有见顶的迹象，通胀风险有所缓和，信用收缩的趋势仍在，但比较平缓，同时地方债发行节奏的错位也令下半年信用收缩的压力有所缓解。政策方面，货币政策维持稳健中性，流动性维持平稳。利率债策略：央行稳健中性的货币政策取向明确，下半年基本面利多因素逐渐增加，但目前绝对收益率偏低，预计维持震荡走势，向上和向下空间均不足。对利率债看法中性。信用债方面：目前信用风险依然较高，低等级信用债应规避为主，中高等级信用债也需要精细择券，需密切关注受信用风险冲击较大的发债主体，严防信用风险。

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、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程

中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同约定，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认为的收益分配方式是现金分红；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；同一类别每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

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，本基金托管人在对南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)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，南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)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。本报告期内南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 未进行利润分配。

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南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 2021 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：南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	15,670,019.89	9,224,587.23
结算备付金		268,872.58	47,072.25
存出保证金		18,633.04	49,970.62
交易性金融资产	6.4.3.2	1,224,381,949.64	1,030,104,568.71
其中：股票投资		171,801,958.77	165,029,888.59
基金投资		1,050,922,949.75	864,867,889.02
债券投资		1,657,041.12	206,791.10
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.3.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.3.4	—	—
应收证券清算款		—	7,000,023.47
应收利息	6.4.3.5	3,337.79	1,016.81
应收股利		0.83	0.84
应收申购款		2,249,708.98	3,950,790.86
递延所得税资产		—	—

其他资产	6.4.3.6	5,663.03	5,593.61
资产总计		1,242,598,185.78	1,050,383,624.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		612,738.14	519,130.25
应付托管费		114,125.79	98,084.64
应付销售服务费		44,215.27	39,007.32
应付交易费用	6.4.3.7	32,373.38	43,227.87
应交税费		5.12	0.57
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	104,138.35	180,000.00
负债合计		907,596.05	879,450.65
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	751,238,298.43	675,399,035.32
未分配利润	6.4.3.10	490,452,291.30	374,105,138.43
所有者权益合计		1,241,690,589.73	1,049,504,173.75
负债和所有者权益总计		1,242,598,185.78	1,050,383,624.40

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，南方养老目标日期 2035(FOF)A 份额净值 1.6548 元，基金份额总额 667,337,745.98 份；南方养老目标日期 2035(FOF)C 份额净值 1.6374 元，基金份额总额 83,900,552.45 份；总份额合计 751,238,298.43 份。

6.2 利润表

会计主体：南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		75,789,219.83	57,472,337.32
1. 利息收入		45,231.24	121,837.87
其中：存款利息收入	6.4.3.11	43,882.30	53,634.76
债券利息收入		1,348.94	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	68,203.11
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		26,508,250.28	33,551,591.60
其中：股票投资收益	6.4.3.12	18,437,900.86	15,657,555.46
基金投资收益	6.4.3.13	-1,480.87	10,762,272.27
债券投资收益	6.4.3.14	25,678.09	-
资产支持证券投资	6.4.3.15	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.3.16	-	-
衍生工具收益	6.4.3.17	-	-
股利收益	6.4.3.18	8,046,152.20	7,131,763.87
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	49,201,405.06	23,701,857.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.20	34,333.25	97,050.29
减：二、费用		4,738,352.97	3,127,229.95
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	3,550,844.03	2,079,522.41
2. 托管费	6.4.6.2.2	648,041.30	401,181.36

3. 销售服务费	6. 4. 6. 2. 3	254, 036. 18	157, 834. 18
4. 交易费用	6. 4. 3. 21	171, 712. 55	366, 720. 70
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0. 56	22, 445. 70
7. 其他费用	6. 4. 3. 22	113, 718. 35	99, 525. 60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		71, 050, 866. 86	54, 345, 107. 37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		71, 050, 866. 86	54, 345, 107. 37

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	675, 399, 035. 32	374, 105, 138. 43	1, 049, 504, 173. 75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	71, 050, 866. 86	71, 050, 866. 86
三、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）	75, 839, 263. 11	45, 296, 286. 01	121, 135, 549. 12
其中：1. 基金申购款	75, 839, 263. 11	45, 296, 286. 01	121, 135, 549. 12
2. 基金赎回款	-	-	-
四、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)			
五、期末所有者权益(基金净值)	751,238,298.43	490,452,291.30	1,241,690,589.73
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	505,515,878.18	82,251,531.77	587,767,409.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	54,345,107.37	54,345,107.37
三、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)	95,343,221.48	17,051,645.67	112,394,867.15
其中：1. 基金申购款	95,343,221.48	17,051,645.67	112,394,867.15
2. 基金赎回款	-	-	-
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	600,859,099.66	153,648,284.81	754,507,384.47

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	15,670,019.89
定期存款	-
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	-
合计	15,670,019.89

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		119,382,501.19	171,801,958.77	52,419,457.58
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,527,000.00	1,657,041.12	130,041.12
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,527,000.00	1,657,041.12	130,041.12
资产支持证券		-	-	-
基金		906,909,657.33	1,050,922,949.75	144,013,292.42
其他		-	-	-
合计		1,027,819,158.52	1,224,381,949.64	196,562,791.12

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,886.29
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	108.90
应收债券利息	1,335.04
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	7.56
合计	3,337.79

6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	5,663.03
待摊费用	-
合计	5,663.03

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	32,373.38
银行间市场应付交易费用	-
合计	32,373.38

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	104,138.35
合计	104,138.35

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

南方养老目标日期 2035(FOF)A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	597,361,959.07	597,361,959.07
本期申购	69,975,786.91	69,975,786.91
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	667,337,745.98	667,337,745.98

南方养老目标日期 2035(FOF)C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	78,037,076.25	78,037,076.25
本期申购	5,863,476.20	5,863,476.20
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	83,900,552.45	83,900,552.45

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。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

南方养老目标日期 2035(FOF)A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	183,228,263.15	148,571,275.08	331,799,538.23
本期利润	19,630,914.11	43,673,441.59	63,304,355.70
本期基金份额交易产生的变动数	22,317,159.35	19,554,491.38	41,871,650.73
其中：基金申购款	22,317,159.35	19,554,491.38	41,871,650.73
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	225,176,336.61	211,799,208.05	436,975,544.66

南方养老目标日期 2035(FOF)C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	23,025,391.05	19,280,209.15	42,305,600.20
本期利润	2,218,547.69	5,527,963.47	7,746,511.16
本期基金份额交易产生的变动数	1,798,654.75	1,625,980.53	3,424,635.28
其中：基金申购款	1,798,654.75	1,625,980.53	3,424,635.28
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,042,593.49	26,434,153.15	53,476,746.64

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	41,855.29
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	900.48
其他	1,126.53
合计	43,882.30

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	58,509,501.89
减：卖出股票成本总额	40,071,601.03
买卖股票差价收入	18,437,900.86

6.4.3.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	25,625,874.92
减：卖出/赎回基金成本总额	25,627,355.79
基金投资收益	-1,480.87

6.4.3.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	178,724.92
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	153,000.00
减：应收利息总额	46.83
买卖债券差价收入	25,678.09

6.4.3.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.3.16 贵金属投资收益

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.3.17 衍生工具收益

6.4.3.17.1 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。

6.4.3.17.2 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。

6.4.3.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,128,838.07
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	6,917,314.13
合计	8,046,152.20

6.4.3.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	49,201,405.06
——股票投资	7,778,544.67
——债券投资	106,250.02
——资产支持证券投资	-
——基金投资	41,316,610.37
——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	49,201,405.06

6.4.3.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-

基金销售服务费返还收入	33,634.25
其他	699.00
合计	34,333.25

6.4.3.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	167,712.55
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	4,000.00
其中：申购费	4,000.00
赎回费	-
场内交易费	-
其他	-
合计	171,712.55

6.4.3.21.1 持有基金产生的费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	325,582.09
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	4,565,771.96
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	848,503.67

6.4.3.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	580.00
合计	113,718.35

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、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(“华泰联合证券”)	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

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股票交易。

6.4.6.1.2 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.6.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,550,844.03	2,079,522.41
其中：支付销售机构的客户维护费	1,239,896.90	382,944.63

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的 0.90% 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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额 $\times 0.90\%$ / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	648,041.30	401,181.36

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的 0.15% 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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额 $\times 0.15\%$ / 当年天数。

6.4.6.2.3 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方养老目标日期 2035(FOF)A	南方养老目标日期 2035(FOF)C	合计
工商银行	-	8,605.43	8,605.43
华泰证券	-	15,596.72	15,596.72
南方基金	-	29,596.83	29,596.83
兴业证券	-	429.35	429.35
合计	-	54,228.33	54,228.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方养老目标日期 2035(FOF)A	南方养老目标日期 2035(FOF)C	合计
华泰证券	-	10,510.62	10,510.62
南方基金	-	20,204.45	20,204.45
兴业证券	-	173.75	173.75
中国工商银行	-	4,916.87	4,916.87
合计	-	35,805.69	35,805.69

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 0.40% 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 $\times 0.40\%$ / 当年天数。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	15,670,019.89	41,855.29	2,691,178.91	39,698.88

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
华泰联合证券	113050	南银转债	优先配售	960	96,000.00
兴业证券	605086	龙高股份	网下申购	443	5,696.98
华泰联合证	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40

券					
兴业证券	605298	必得科技	网下申购	391	6,252.09
华泰联合证 券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证 券	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证 券	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合证 券	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证 券	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
兴业证券	688195	腾景科技	网下申购	2,693	36,624.80
华泰联合证 券	688260	昀冢科技	网下申购	2,990	28,793.70
华泰联合证 券	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证 券	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
兴业证券	688597	煜邦电力	网下申购	3,907	22,973.16
华泰联合证 券	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证 券	688633	星球石墨	网下申购	1,558	52,379.96
兴业证券	688639	华恒生物	网下申购	2,302	53,314.32
兴业证券	300941	创识科技	网下申购	3,989	85,005.59
华泰联合证 券	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16
兴业证券	300979	华利集团	网下申购	9,246	307,152.12

上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
华泰联合证 券	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有基金管理人南方基金所管理的公开募集证券投资基金，成本总额为人民币 342,701,018.71 元，估值总额为人民币 388,872,939.47 元，占本基

金基金资产净值的比例为 31.32%（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有基金管理人南方基金所管理的公开募集证券投资基金，成本总额为人民币 291,505,850.65 元，估值总额为人民币 326,861,611.46 元，占本基金基金资产净值的比例为 31.14%）。

6.4.6.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费 (元)	-	-
当期交易基金产生的赎回费 (元)	-	93,199.75
当期持有基金产生的应支付 销售服务费(元)	33,634.25	97,050.29
当期持有基金产生的应支付 管理费(元)	1,615,397.98	821,681.06
当期持有基金产生的应支付 托管费(元)	304,550.16	173,413.10

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金(ETF 除外)，应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费(按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外)、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为 0，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.8 期末（2021 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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

002294	信立泰	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 24 日	非公开发 行锁 定期	28.37	30.82	35,249	1,000,014.1 3	1,086,374.1 8	-
002497	雅化集团	2021 年 1 月 27 日	2021 年 7 月 29 日	非公开发 行锁 定期	14.01	21.93	71,378	1,000,005.7 8	1,565,319.5 4	-
002853	皮阿诺	2021 年 1 月 26 日	2021 年 7 月 27 日	非公开发 行锁 定期	19.23	21.23	52,003	1,000,017.6 9	1,104,023.6 9	-
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	创业板 新股锁 定期	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300762	上海瀚讯	2021 年 6 月 3 日	2021 年 11 月 15 日	锁定期 转增	-	26.66	18,462	-	492,196.92	-
300762	上海瀚讯	2021 年 4 月 29 日	2021 年 11 月 15 日	非公开发 行锁 定期	32.50	26.66	30,770	1,000,025.0 0	820,328.20	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	创业板 新股锁 定期	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	创业板 新股锁 定期	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	创业板 新股锁 定期	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	创业板 新股锁 定期	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	创业板 新股锁 定期	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	创业板 新股锁 定期	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	创业板 新股锁 定期	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021 年 6 月 4 日	2021 年 8 月 25 日	锁定期 转增	-	27.42	108	-	2,961.36	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18	2021 年 8 月 25	创业板 新股锁	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-

		日	日	定期						
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	创业板 新股锁 定期	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	创业板 新股锁 定期	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300957	贝 泰 妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	创业板 新股锁 定期	47.33	251.9 6	853	40,372.49	214,921.88	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	创业板 新股锁 定期	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	创业板 新股锁 定期	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	创业板 新股锁 定期	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	创业板 新股锁 定期	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	创业板 新股锁 定期	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	创业板 新股锁 定期	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	创业板 新股锁 定期	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	创业板 新股锁 定期	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业板 新股锁 定期	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业板 新股锁 定期	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	创业板 新股锁 定期	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300987	川网传媒	2021 年	2021 年	创业板	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-

		4月28日	11月11日	新股锁定期						
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	创业板新股锁定期	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	创业板新股锁定期	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	创业板新股锁定期	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	创业板新股锁定期	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	创业板新股锁定期	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	创业板新股锁定期	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	创业板新股锁定期	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	创业板新股锁定期	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	创业板新股锁定期	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	创业板新股锁定期	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	创业板新股锁定期	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	创业板新股锁定期	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	创业板新股锁定期	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-

301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
605162	新 中 港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未 上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未 上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688191	智洋创新	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 8 日	科创板 新股锁 定期	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未 上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股未 上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688517	金冠电气	2021 年 6 月 10 日	2021 年 12 月 20 日	科创板 新股锁 定期	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
688565	力源科技	2021 年 5 月 6 日	2021 年 11 月 15 日	科创板 新股锁 定期	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-
688676	金盘科技	2021 年 3 月 2 日	2021 年 9 月 9 日	科创板 新股锁 定期	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-
688681	科汇股份	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	科创板 新股锁 定期	9.56	14.54	1,875	17,925.00	27,262.50	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 7 月 2 日	创业板 新股锁 定期	24.60	163.0 0	610	15,006.00	99,430.00	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认 购日	可流通 日	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
113049	长汽转债	2021 年 6 月 11 日	2021 年 7 月 8 日	配债未 上市	100.0 0	100.0 0	60	6,000.00	6,000.00	-
113050	南银转债	2021 年	2021 年	配债未	100.0	100.0	960	96,000.00	96,000.00	-

		6 月 16 日	7 月 1 日	上市	0	0				
--	--	-------------	------------	----	---	---	--	--	--	--

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。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。

3、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

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。

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

无。

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

本基金为基金中基金，2035 年 12 月 31 日为本基金的目标日期。从建仓期结束起至目标日期止，本基金的风险与收益水平将逐步降低。即本基金初始投资阶段的风险收益水平接近一般的混合型基金，随着目标日期的临近，本基金逐步发展为低风险混合型基金中基金。目标日期到达后，本基金相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小，但高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金通过大类资产配置，投资于多种具有不同风险收益特征的基金，并随着目标日期的临近逐步降低本基金整体的风险收益水平，以寻求基金资产的长期稳健增值。目标日期到达后，本基金将在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。

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之内。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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，在场外申赎基金份额均通过该基金的基金管理人的直销柜台办理，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。

本基金基于内部评价系统对基金管理公司及其管理基金的评级，将投资于管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的基金。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于锁定期届满后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自基金合同生效日满三年起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 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.1 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，其余亦可在基金销售机构申购、赎回，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。在本基金开放日，本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的 10%；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%。

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	15,670,019.89	-	-	-	15,670,019.89
结算备付金	268,872.58	-	-	-	268,872.58
存出保证金	18,633.04	-	-	-	18,633.04
交易性金融资产	-	4,070.08	1,652,971.04	1,222,724,908.52	1,224,381,949.64
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,337.79	3,337.79
应收股利	-	-	-	0.83	0.83
应收申购款	82,091.98	-	-	2,167,617.00	2,249,708.98
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	5,663.03	5,663.03
资产总计	16,039,617.49	4,070.08	1,652,971.04	1,224,901,527.17	1,242,598,185.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	612,738.14	612,738.14
应付托管费	-	-	-	114,125.79	114,125.79
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	44,215.27	44,215.27
应付交易费用	-	-	-	32,373.38	32,373.38
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	5.12	5.12
其他负债	-	-	-	104,138.35	104,138.35
负债总计	-	-	-	907,596.05	907,596.05
利率敏感度缺口	16,039,617.49	4,070.08	1,652,971.04	1,223,993,931.12	1,241,690,589.73
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,224,587.23	-	-	-	9,224,587.23
结算备付金	47,072.25	-	-	-	47,072.25
存出保证金	49,970.62	-	-	-	49,970.62
交易性金融资产	-	44,836.90	161,954.20	1,029,897,777.61	1,030,104,568.71
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,016.81	1,016.81
应收股利	-	-	-	0.84	0.84
应收申购款	255,671.21	-	-	3,695,119.65	3,950,790.86
应收证券清算款	-	-	-	7,000,023.47	7,000,023.47
其他资产	-	-	-	5,593.61	5,593.61
资产总计	9,577,301.31	44,836.90	161,954.20	1,040,599,531.99	1,050,383,624.40
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	519,130.25	519,130.25
应付托管费	-	-	-	98,084.64	98,084.64
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	39,007.32	39,007.32
应付交易费用	-	-	-	43,227.87	43,227.87
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.57	0.57
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	879,450.65	879,450.65
利率敏感度	9,577,301.31	44,836.90	161,954.20	1,039,720,08	1,049,504,17

缺口				1.34	3.75
----	--	--	--	------	------

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(2021年6月30日)	上年度末(2020年12月31日)
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-22,297.42	-2,885.67
	2.市场利率平行下降 25 个基点	22,662.07	2,934.29

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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、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,以宏观经济分析为重点,基于经济结构调整过程中相关政策与法规的变化、证券市场环境、金融市场利率变化、经济运行周期、投资者情绪以及证券市场不同类别资产的风险/收益状况等,判断宏观经济发展趋势、政策导向和证券市场的未来发展趋势,确定和构造合适的资产配置比例。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金 80%以上基金资产投资于其他经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额(含 QDII、香港互认基金);其中投资于股票(含存托凭证)、股票型基金、混合型基金和商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)等品种的比例合计不超过基金资产的 60%;投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	171,801,958.77	13.84	165,029,888.59	15.72
交易性金融资产-基金投资	1,050,922,949.75	84.64	864,867,889.02	82.41
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	1,222,724,908.52	98.48	1,029,897,777.61	98.13

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	64,709,916.53	52,772,740.98
	2.组合自身基准下降 5%	-64,709,916.53	-52,772,740.98

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	171,801,958.77	13.83
	其中：股票	171,801,958.77	13.83
2	基金投资	1,050,922,949.75	84.57
3	固定收益投资	1,657,041.12	0.13
	其中：债券	1,657,041.12	0.13
	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	15,938,892.47	1.28
8	其他资产	2,277,343.67	0.18
9	合计	1,242,598,185.78	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	234,518.40	0.02
B	采矿业	7,360,132.72	0.59
C	制造业	110,196,912.58	8.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,350,727.39	0.11
E	建筑业	1,714,483.37	0.14
F	批发和零售业	549,673.26	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	1,700,744.00	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,022,238.46	0.65
J	金融业	25,430,473.90	2.05
K	房地产业	1,378,735.20	0.11
L	租赁和商务服务业	914,652.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	331,501.03	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	4,277,927.68	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	43,869.00	0.00
Q	卫生和社会工作	7,735,929.78	0.62
R	文化、体育和娱乐业	559,440.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	171,801,958.77	13.84

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	300750	宁德时代	22,700	12,139,960.00	0.98
2	600519	贵州茅台	3,400	6,992,780.00	0.56
3	300760	迈瑞医疗	13,000	6,240,650.00	0.50

4	002142	宁波银行	137,872	5,372,871.84	0.43
5	688122	西部超导	79,551	5,160,473.37	0.42
6	601088	中国神华	263,000	5,133,760.00	0.41
7	300015	爱尔眼科	65,711	4,664,166.78	0.38
8	300059	东方财富	139,224	4,565,154.96	0.37
9	300124	汇川技术	54,750	4,065,735.00	0.33
10	300816	艾 可 蓝	38,300	3,270,054.00	0.26
11	300274	阳光电源	27,900	3,210,174.00	0.26
12	603589	口 子 窖	46,900	3,174,661.00	0.26
13	300347	泰格医药	15,500	2,996,150.00	0.24
14	002271	东方雨虹	54,100	2,992,812.00	0.24
15	601318	中国平安	44,500	2,860,460.00	0.23
16	300122	智飞生物	15,166	2,831,947.18	0.23
17	002056	横店东磁	212,800	2,766,400.00	0.22
18	000672	上峰水泥	137,100	2,396,508.00	0.19
19	601012	隆基股份	25,900	2,300,956.00	0.19
20	002311	海大集团	26,600	2,170,560.00	0.17
21	600132	重庆啤酒	10,500	2,078,475.00	0.17
22	300408	三环集团	48,300	2,048,886.00	0.17
23	300136	信维通信	65,200	2,013,376.00	0.16
24	601966	玲珑轮胎	38,494	1,683,727.56	0.14
25	300502	新 易 盛	53,000	1,656,250.00	0.13
26	600999	招商证券	86,700	1,649,034.00	0.13
27	000858	五 粮 液	5,400	1,608,606.00	0.13
28	601166	兴业银行	76,600	1,574,130.00	0.13
29	002497	雅化集团	71,378	1,565,319.54	0.13
30	600309	万华化学	13,900	1,512,598.00	0.12
31	300601	康泰生物	9,200	1,370,800.00	0.11
32	600887	伊利股份	36,100	1,329,563.00	0.11
33	300762	上海瀚讯	49,232	1,312,525.12	0.11
34	600276	恒瑞医药	16,783	1,140,740.51	0.09
35	300450	先导智能	18,720	1,125,820.80	0.09
36	002853	皮 阿 诺	52,003	1,104,023.69	0.09
37	300496	中科创达	7,000	1,099,420.00	0.09
38	002230	科大讯飞	16,200	1,094,796.00	0.09
39	002294	信 立 泰	35,249	1,086,374.18	0.09
40	600436	片 仔 癯	2,400	1,075,920.00	0.09
41	601919	中远海控	34,500	1,053,630.00	0.08
42	000786	北新建材	26,600	1,044,050.00	0.08
43	601668	中国建筑	221,700	1,030,905.00	0.08
44	600900	长江电力	49,400	1,019,616.00	0.08
45	688561	奇 安 信	10,417	961,593.27	0.08
46	300316	晶盛机电	18,800	949,400.00	0.08

47	601899	紫金矿业	94,800	918,612.00	0.07
48	002027	分众传媒	97,200	914,652.00	0.07
49	600809	山西汾酒	2,000	896,000.00	0.07
50	000830	鲁西化工	47,600	891,548.00	0.07
51	300253	卫宁健康	53,040	862,960.80	0.07
52	601689	拓普集团	22,201	830,983.43	0.07
53	600000	浦发银行	82,100	821,000.00	0.07
54	300433	蓝思科技	27,300	802,893.00	0.06
55	300207	欣旺达	24,600	800,976.00	0.06
56	600019	宝钢股份	104,200	796,088.00	0.06
57	600690	海尔智家	29,600	766,936.00	0.06
58	601601	中国太保	26,100	756,117.00	0.06
59	300146	汤臣倍健	22,400	736,960.00	0.06
60	600703	三安光电	22,600	724,330.00	0.06
61	300979	华利集团	6,546	721,169.40	0.06
62	600048	保利地产	59,600	717,584.00	0.06
63	600660	福耀玻璃	12,500	698,125.00	0.06
64	002202	金风科技	54,500	662,720.00	0.05
65	600104	上汽集团	29,900	656,903.00	0.05
66	300033	同花顺	5,800	654,124.00	0.05
67	002594	比亚迪	2,600	652,600.00	0.05
68	002415	海康威视	10,100	651,450.00	0.05
69	601328	交通银行	131,800	645,820.00	0.05
70	000568	泸州老窖	2,700	637,038.00	0.05
71	600196	复星医药	8,600	620,318.00	0.05
72	603799	华友钴业	5,330	608,686.00	0.05
73	600438	通威股份	14,000	605,780.00	0.05
74	600570	恒生电子	6,240	581,880.00	0.05
75	300144	宋城演艺	33,300	559,440.00	0.05
76	000001	平安银行	24,200	547,404.00	0.04
77	600585	海螺水泥	12,700	521,335.00	0.04
78	300815	玉禾田	14,800	515,484.00	0.04
79	601988	中国银行	164,600	506,968.00	0.04
80	601628	中国人寿	14,900	504,961.00	0.04
81	601009	南京银行	47,900	503,908.00	0.04
82	688083	中望软件	900	497,070.00	0.04
83	002007	华兰生物	13,550	497,014.00	0.04
84	601229	上海银行	60,320	494,624.00	0.04
85	601766	中国中车	81,300	494,304.00	0.04
86	600919	江苏银行	69,290	491,959.00	0.04
87	601818	光大银行	130,000	491,400.00	0.04
88	002422	科伦药业	24,400	486,780.00	0.04
89	000725	京东方 A	75,400	470,496.00	0.04

90	300896	爱 美 客	589	464,650.32	0.04
91	601288	农业银行	153,200	464,196.00	0.04
92	300088	长信科技	55,900	461,734.00	0.04
93	002475	立讯精密	9,800	450,800.00	0.04
94	000977	浪潮信息	16,000	450,080.00	0.04
95	601169	北京银行	92,400	449,988.00	0.04
96	300024	机 器 人	40,800	435,336.00	0.04
97	600028	中国石化	98,900	431,204.00	0.03
98	300383	光环新网	29,900	430,261.00	0.03
99	601633	长城汽车	9,700	422,823.00	0.03
100	300070	碧 水 源	57,300	418,863.00	0.03
101	600089	特变电工	30,600	393,210.00	0.03
102	600893	航发动力	7,100	377,649.00	0.03
103	002304	洋河股份	1,800	372,960.00	0.03
104	300115	长盈精密	18,000	370,800.00	0.03
105	601225	陕西煤业	31,000	367,350.00	0.03
106	601939	建设银行	54,700	363,755.00	0.03
107	300168	万达信息	24,800	362,080.00	0.03
108	603259	药明康德	2,117	331,501.03	0.03
109	601336	新华保险	7,100	325,961.00	0.03
110	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.03
111	601390	中国中铁	61,800	323,832.00	0.03
112	300315	掌趣科技	75,000	318,750.00	0.03
113	600886	国投电力	33,100	318,091.00	0.03
114	601989	中国重工	77,100	317,652.00	0.03
115	600588	用友网络	9,540	317,300.40	0.03
116	300418	昆仑万维	19,200	314,496.00	0.03
117	600600	青岛啤酒	2,700	312,255.00	0.03
118	601155	新城控股	7,500	312,000.00	0.03
119	000661	长春高新	800	309,600.00	0.02
120	600015	华夏银行	50,000	309,500.00	0.02
121	601006	大秦铁路	46,400	305,312.00	0.02
122	600352	浙江龙盛	21,900	300,906.00	0.02
123	300567	精测电子	4,900	300,860.00	0.02
124	603993	洛阳钼业	57,800	298,248.00	0.02
125	601186	中国铁建	40,100	297,943.00	0.02
126	601788	光大证券	16,600	296,974.00	0.02
127	000401	冀东水泥	23,800	293,930.00	0.02
128	300212	易 华 录	10,680	287,398.80	0.02
129	600760	中航沈飞	4,620	278,586.00	0.02
130	601600	中国铝业	51,600	273,480.00	0.02
131	300618	寒锐钴业	3,400	268,056.00	0.02
132	000338	潍柴动力	14,100	251,967.00	0.02

133	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.02
134	600926	杭州银行	16,300	240,425.00	0.02
135	601877	正泰电器	7,100	236,998.00	0.02
136	600079	人福医药	8,300	234,641.00	0.02
137	300498	温氏股份	16,320	234,518.40	0.02
138	300098	高 新 兴	35,700	215,628.00	0.02
139	300957	贝 泰 妮	853	214,921.88	0.02
140	000100	TCL 科技	28,000	214,200.00	0.02
141	601111	中国国航	27,400	213,172.00	0.02
142	000063	中兴通讯	6,400	212,672.00	0.02
143	600547	山东黄金	10,976	210,958.72	0.02
144	300308	中际旭创	5,400	208,008.00	0.02
145	600522	中天科技	20,800	208,000.00	0.02
146	300068	南都电源	19,400	205,640.00	0.02
147	601099	太 平 洋	59,000	200,010.00	0.02
148	601233	桐昆股份	8,300	199,947.00	0.02
149	603019	中科曙光	6,720	185,539.20	0.01
150	300017	网宿科技	31,600	184,860.00	0.01
151	600383	金地集团	17,700	181,248.00	0.01
152	002129	中环股份	4,500	173,700.00	0.01
153	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.01
154	002001	新 和 成	4,800	137,664.00	0.01
155	601933	永辉超市	28,200	133,386.00	0.01
156	002352	顺丰控股	1,900	128,630.00	0.01
157	000963	华东医药	2,700	124,227.00	0.01
158	000166	申万宏源	24,600	115,128.00	0.01
159	300003	乐普医疗	3,500	112,420.00	0.01
160	000768	中航西飞	4,000	105,120.00	0.01
161	300454	深 信 服	400	103,792.00	0.01
162	603160	汇顶科技	800	103,704.00	0.01
163	600398	海澜之家	14,100	102,084.00	0.01
164	601066	中信建投	3,200	100,576.00	0.01
165	600340	华夏幸福	18,980	99,455.20	0.01
166	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
167	002236	大华股份	4,600	97,060.00	0.01
168	002493	荣盛石化	5,400	93,258.00	0.01
169	000783	长江证券	12,200	89,304.00	0.01
170	002008	大族激光	2,200	88,858.00	0.01
171	688669	聚石化学	2,681	87,909.99	0.01
172	300773	拉 卡 拉	2,900	81,867.00	0.01
173	002044	美年健康	8,300	75,613.00	0.01
174	688658	悦康药业	3,360	75,566.40	0.01
175	000069	华侨城 A	9,200	68,448.00	0.01

176	000860	顺鑫农业	1,500	63,270.00	0.01
177	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.00
178	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.00
179	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
180	600741	华域汽车	2,100	55,167.00	0.00
181	300981	中红医疗	603	54,550.11	0.00
182	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
183	000423	东阿阿胶	1,500	53,865.00	0.00
184	300768	迪普科技	1,300	50,219.00	0.00
185	002405	四维图新	3,300	48,510.00	0.00
186	002065	东华软件	5,900	46,787.00	0.00
187	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
188	002607	中公教育	2,100	43,869.00	0.00
189	601360	三 六 零	3,200	39,072.00	0.00
190	002081	金 螳 螂	4,600	36,432.00	0.00
191	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
192	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.00
193	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.00
194	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
195	688681	科汇股份	1,875	27,262.50	0.00
196	300941	创识科技	489	24,552.06	0.00
197	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
198	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
199	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
200	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
201	300955	嘉亨家化	314	14,830.88	0.00
202	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
203	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
204	300879	大叶股份	560	13,540.80	0.00
205	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
206	300937	药 易 购	244	13,105.24	0.00
207	301013	利 和 兴	471	12,768.81	0.00
208	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
209	300892	品渥食品	272	12,479.36	0.00
210	300966	共同药业	358	12,311.56	0.00
211	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
212	300997	欢 乐 家	928	12,110.40	0.00
213	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
214	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
215	300895	铜牛信息	339	11,529.39	0.00
216	300962	中金辐照	657	11,373.12	0.00
217	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
218	300930	屹通新材	420	10,321.78	0.00

219	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
220	300881	盛德鑫泰	291	8,959.89	0.00
221	300945	曼 卡 龙	474	8,949.12	0.00
222	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
223	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
224	605162	新 中 港	1,377	8,358.39	0.00
225	300987	川网传媒	304	8,186.69	0.00
226	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
227	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
228	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
229	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
230	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
231	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
232	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
233	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
234	301010	晶雪节能	272	5,127.96	0.00
235	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
236	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
237	301007	德 迈 仕	303	4,375.32	0.00
238	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
239	300992	泰福泵业	200	4,064.00	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。

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	002056	横店东磁	3,301,592.00	0.31
2	300816	艾 可 蓝	3,287,126.00	0.31
3	300059	东方财富	2,998,963.00	0.29
4	603589	口 子 窖	2,993,758.00	0.29
5	000672	上峰水泥	2,830,713.00	0.27
6	603378	亚士创能	2,799,620.00	0.27
7	002271	东方雨虹	2,659,889.00	0.25
8	603416	信捷电气	2,106,299.00	0.20
9	002311	海大集团	1,579,194.00	0.15
10	603565	中谷物流	1,497,999.00	0.14
11	300762	上海瀚讯	1,000,025.00	0.10
12	002853	皮 阿 诺	1,000,017.69	0.10

13	002294	信立泰	1,000,014.13	0.10
14	002497	雅化集团	1,000,005.78	0.10
15	601689	拓普集团	996,843.82	0.09
16	688538	和辉光电	822,769.35	0.08
17	300957	贝泰妮	403,393.59	0.04
18	688425	铁建重工	388,259.34	0.04
19	300979	华利集团	307,152.12	0.03
20	300981	中红医疗	291,685.77	0.03

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	603416	信捷电气	5,631,780.60	0.54
2	300059	东方财富	4,044,880.00	0.39
3	000157	中联重科	3,692,435.00	0.35
4	603378	亚士创能	3,061,728.00	0.29
5	000625	长安汽车	3,042,971.36	0.29
6	601577	长沙银行	2,997,669.00	0.29
7	601318	中国平安	2,995,920.00	0.29
8	600019	宝钢股份	2,645,848.64	0.25
9	603565	中谷物流	2,045,402.24	0.19
10	688185	康希诺	1,467,857.28	0.14
11	300684	中石科技	1,375,877.00	0.13
12	688538	和辉光电	1,355,408.93	0.13
13	300957	贝泰妮	1,352,191.90	0.13
14	002821	凯莱英	1,233,663.90	0.12
15	688425	铁建重工	1,060,412.71	0.10
16	600016	民生银行	864,657.00	0.08
17	002595	豪迈科技	785,937.00	0.07
18	688608	恒玄科技	774,694.10	0.07
19	300981	中红医疗	707,145.00	0.07
20	688696	极米科技	678,035.04	0.06

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	39,065,126.54
卖出股票收入（成交）总额	58,509,501.89

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	-	-
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）	1,657,041.12	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,657,041.12	0.13

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	113042	上银转债	11,550	1,181,334.00	0.10
2	123111	东财转 3	2,128	311,454.08	0.03
3	113050	南银转债	960	96,000.00	0.01
4	127025	冀东转债	498	53,271.06	0.00
5	113049	长汽转债	60	6,000.00	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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

在开放式基金投资方面，考虑到基金费率优惠等因素，本基金将主要投资于本基金管理人旗下的基金，同时基于南方基金评价系统对基金管理公司及其管理的基金的评级，将投资于管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的基金，以分享资本市场的成长。

在股票型基金选择上，对于主动管理的股票型基金，使用动量策略，重点参考基金规模、历史年化收益率、是否开放申购赎回等因素，选择优胜者进行投资。对于指数基金，由于具有高透明度、风格明确、费用低等多项优势，通过优选指数基金，可配合市场、行业板块轮动等，在不同指数基金间调换，同时可运用事件套利、配对交易等组合策略套利等，增强基金投资收益。被动管理的指数基金，使用跟踪误差、累计偏离、基金规模、是否是市场基准指数、是否开放申购赎回等因素，选择优胜者进行投资。

在混合型基金选择上，考虑到混合型基金投资仓位的变化、基金投资风格、投资标的等因素，将重点选择业绩优异、风格鲜明、风险控制较好的基金进行投资。

对于主动管理的债券基金、货币市场基金，采用长期投资业绩领先、基金规模较大、流动性较好、持有债券的平均久期适当、可以准确识别信用风险并且投资操作风格与当前市场环境相匹配的基金管理人，重点参考基金规模、历史年化收益率、波动率、夏普比例、是否开放申购赎回等因素。

大宗商品基金选择上，重点选择具备有效抵御通胀，与其他资产的相关度低的基金。

在上市的 ETF、LOF 的套利投资方面，通过量化套利策略以及先进的交易手段，及时捕捉市场的折溢价机会。

南方养老 2035 以基金为主要投资标的构建投资组合。因此，组合面临因子基金暂停大额赎回而产生的流动性风险。此外基金可参与股票、债券和商品多等资产投资，因此组合可能面临各大类资产的市场风险、利率风险、流动性风险等。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)	是否属于 基金管理人及管理人 关联方所管理的 基金
1	001580	南方利安 灵活配置 混合 C	契约型开 放式	45,770,81 2.17	63,850,28 2.98	5.14	是
2	004517	南方安康 混合	契约型开 放式	42,289,35 7.99	47,901,15 5.80	3.86	是
3	005242	中欧时代 智慧混合 C	契约型开 放式	17,934,71 3.75	43,299,77 9.41	3.49	否
4	002015	南方荣光 灵活配置 混合 A	契约型开 放式	27,712,08 7.01	40,570,49 5.38	3.27	是
5	004648	南方安睿 混合	契约型开 放式	33,920,83 9.43	38,937,73 1.58	3.14	是
6	519069	汇添富价 值精选混 合 A	契约型开 放式	8,779,045 .09	35,520,01 6.43	2.86	否
7	160916	大成优选 混合 (LOF)	契约型开 放式	8,258,691 .63	35,099,43 9.43	2.83	否
8	166019	中欧价值 智选回报 混合 A	契约型开 放式	6,990,333 .03	34,179,23 3.35	2.75	否
9	004720	华夏睿磐 泰茂混合 A	契约型开 放式	26,922,58 8.24	33,798,61 7.28	2.72	否
10	270008	广发核心 精选混合	契约型开 放式	6,357,772 .31	31,572,69 7.29	2.54	否
11	001746	易方达瑞 富灵活配	契约型开 放式	20,895,51 7.40	27,059,69 5.03	2.18	否

		置混合 E					
12	002411	华夏新机遇灵活配置混合 A	契约型开放式	21,664,941.88	26,084,590.02	2.10	否
13	001444	易方达瑞选灵活配置混合 E	契约型开放式	15,099,842.53	24,310,746.47	1.96	否
14	512000	华宝中证全指证券公司 ETF	契约型开放式	22,087,100.00	23,456,500.20	1.89	否
15	001053	南方创新经济灵活配置混合	契约型开放式	7,607,079.00	23,270,054.66	1.87	是
16	002160	南方转型驱动灵活配置混合	契约型开放式	6,125,020.37	22,080,698.43	1.78	是
17	002120	广发安悦回报灵活配置混合 A	契约型开放式	19,044,649.45	21,823,263.80	1.76	否
18	004750	广发鑫和灵活配置混合 A	契约型开放式	17,134,481.91	21,729,949.96	1.75	否
19	002803	东方红沪港深灵活配置混合	契约型开放式	7,129,272.65	21,444,852.13	1.73	否
20	003476	南方安颐混合	契约型开放式	17,460,793.80	19,507,198.83	1.57	是
21	001667	南方转型增长灵活配置混合	契约型开放式	9,411,129.06	18,718,735.70	1.51	是
22	005059	南方安福混合 A	契约型开放式	16,732,460.33	18,173,125.16	1.46	是
23	002577	南方新兴龙头灵活配置混合	契约型开放式	10,204,956.69	18,062,773.34	1.45	是
24	001330	鹏华弘实灵活配置混合 C	契约型开放式	11,023,443.80	16,885,711.21	1.36	否
25	001500	泓德远见回报混合	契约型开放式	7,412,157.15	16,736,650.84	1.35	否
26	000844	南方绝对收益策略定期开放	契约型开放式	10,924,484.50	16,463,198.14	1.33	是

		混合					
27	003105	光大保德信永鑫灵活配置混合 A	契约型开放式	3,660,078.09	15,544,351.65	1.25	否
28	002261	中银宝利灵活配置混合 A	契约型开放式	12,004,015.37	13,612,553.43	1.10	否
29	004202	华夏睿磐泰兴混合	契约型开放式	9,876,533.05	13,389,615.86	1.08	否
30	003106	光大保德信永鑫灵活配置混合 C	契约型开放式	3,058,478.10	12,952,654.75	1.04	否
31	000541	华商创新成长灵活配置混合	契约型开放式	3,886,125.15	12,598,817.74	1.01	否
32	002431	中银丰利灵活配置混合 C	契约型开放式	10,483,983.45	11,815,449.35	0.95	否
33	004721	华夏睿磐泰茂混合 C	契约型开放式	9,392,317.08	11,674,650.13	0.94	否
34	003161	南方安泰混合 A	契约型开放式	9,924,584.29	11,295,169.38	0.91	是
35	004225	国寿安保稳诚混合 A	契约型开放式	9,719,016.64	10,892,101.95	0.88	否
36	005618	融通红利机会主题精选灵活配置混合 A	契约型开放式	5,313,811.98	10,874,184.84	0.88	否
37	000954	国泰睿吉灵活配置混合 C	契约型开放式	10,359,934.16	10,660,372.25	0.86	否
38	001442	易方达瑞信灵活配置混合 E	契约型开放式	7,304,601.90	10,613,586.56	0.85	否
39	005397	南方安养混合	契约型开放式	9,684,043.24	10,599,185.33	0.85	是
40	002054	中银新财富灵活配置混合 A	契约型开放式	8,672,159.58	10,562,690.37	0.85	否

41	002430	中银丰利 灵活配置 混合 A	契约型开 放式	9,131,506 .85	10,309,47 1.23	0.83	否
42	002413	中银瑞利 灵活配置 混合 A	契约型开 放式	8,575,471 .70	10,221,96 2.27	0.82	否
43	511990	华宝现金 添益交易 货币 A	契约型开 放式	100,019.0 0	10,001,19 9.87	0.81	否
44	001764	广发沪港 深新机遇 股票	契约型开 放式	5,364,270 .39	9,870,257 .52	0.79	否
45	004357	南方智慧 精选灵活 配置混合	契约型开 放式	3,268,828 .45	9,257,975 .94	0.75	是
46	002498	兴业聚鑫 灵活配置 混合 A	契约型开 放式	6,290,895 .63	9,046,307 .92	0.73	否
47	202212	南方平衡 配置混合	契约型开 放式	2,534,594 .48	7,723,669 .76	0.62	是
48	004703	南方兴盛 先锋灵活 配置混合	契约型开 放式	3,658,284 .21	7,181,211 .90	0.58	是
49	007043	新疆前海 联合泓鑫 灵活配置 混合 C	契约型开 放式	1,828,019 .89	6,707,187 .78	0.54	否
50	001807	易方达瑞 智灵活配 置混合 E	契约型开 放式	5,219,348 .59	6,498,088 .99	0.52	否
51	001692	南方国策 动力股票	契约型开 放式	2,464,268 .11	6,148,348 .93	0.50	是
52	513050	易方达中 证海外中 国互联网 50ETF(Q DII)	契约型开 放式	3,111,618 .00	6,011,645 .98	0.48	否
53	002482	宝盈互联 网沪港深 灵活配置 混合	契约型开 放式	1,663,007 .32	5,833,829 .68	0.47	否
54	001567	南方利达 灵活配置 混合 C	契约型开 放式	4,074,979 .62	5,452,322 .73	0.44	是

55	005039	鹏扬景兴混合 A	契约型开放式	4,015,344.95	5,340,408.78	0.43	否
56	004975	交银施罗德恒益灵活配置混合	契约型开放式	4,402,078.20	5,256,521.58	0.42	否
57	002615	中银颐利灵活配置混合 C	契约型开放式	3,958,828.19	5,249,406.18	0.42	否
58	002056	中银新财富灵活配置混合 C	契约型开放式	4,314,063.85	5,228,645.39	0.42	否
59	485111	工银瑞信双利债券 A	契约型开放式	2,908,596.11	4,953,339.18	0.40	否
60	002489	国泰民福策略价值灵活配置混合	契约型开放式	2,206,622.87	3,320,305.43	0.27	否
61	001570	南方利安灵活配置混合 A	契约型开放式	1,845,353.83	2,579,804.65	0.21	是
62	001334	南方利鑫灵活配置混合 A	契约型开放式	351,703.76	545,140.83	0.04	是
63	001183	南方利淘灵活配置混合 A	契约型开放式	345,617.51	542,965.11	0.04	是
64	003474	南方天天利货币 B	契约型开放式	9,457.73	9,457.73	0.00	是
65	002701	东方红汇阳债券 A	契约型开放式	7,751.52	8,660.77	0.00	否
66	002325	南方日添益货币 E	契约型开放式	2,237.18	2,237.18	0.00	是

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	18,633.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	0.83
4	应收利息	3,337.79
5	应收申购款	2,249,708.98
6	其他应收款	5,663.03
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,277,343.67

7.13.4 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	127025	冀东转债	53,271.06	0.00
2	128136	立讯转债	4,911.90	0.00

7.13.5 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

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
南方养老目标日期 2035(FOF) A	86,971	7,673.11	127,937,074.40	19.17%	539,400,671.58	80.83%
南方养老目标日期	16,428	5,107.17	7,021,583.32	8.37%	76,878,969.13	91.63%

2035(FOF) C						
合计	103,399	7,265.43	134,958,65 7.72	17.96%	616,279,64 0.71	82.04%

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。

8.2 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	南方养老目标日期 2035(FOF)A	2,167,470.16	0.3248%
	南方养老目标日期 2035(FOF)C	353,002.00	0.4207%
	合计	2,520,472.16	0.3355%

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）。

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	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	南方养老目标日期 2035(FOF)A	0~10
	南方养老目标日期 2035(FOF)C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	南方养老目标日期 2035(FOF)A	10~50
	南方养老目标日期 2035(FOF)C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方养老目标日期 2035(FOF)A	南方养老目标日期 2035(FOF)C
----	---------------------	---------------------

基金合同生效日(2018 年 11 月 6 日)基金份额总额	329,777,936.20	50,581,081.47
本报告期期初基金份额总额	597,361,959.07	78,037,076.25
本报告期基金总申购份额	69,975,786.91	5,863,476.20
减：报告期基金总赎回份额	-	-
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	667,337,745.98	83,900,552.45

§ 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

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长病逝缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

2021 年 5 月 19 日，公司副总经理常克川兼任首席信息官。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

南方利安灵活配置混合型证券投资基金和南方利鑫灵活配置混合型证券投资基金于 2021 年 6 月 1 日公开召开基金份额持有人大会，就持有人大会审议事项南方养老目标日期 2035 (FOF) 投同意票。

10.6 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。

10.7 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
海通证券	1	45,598,803.09	53.29%	40,203.20	52.47%	-
国信证券	1	39,962,695.62	46.71%	36,416.97	47.53%	-
华泰证券	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。

10.8.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
海通证券	148,985.80	83.36%	-	-	-	-	91,260,935.96	100.00%
国信证券	29,739.12	16.64%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 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公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-25
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金获配皮阿诺（002853）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-28
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金获配雅化集团（002497）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-29
4	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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-04
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公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-23
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公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-02
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公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-08
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公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-16
9	南方基金关于旗下部分基金增加汇成基金为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-17
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公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会	2021-03-19

		基金电子披露网站	
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公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
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公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-29
13	南方基金关于旗下部分基金增加中国银行为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
14	南方基金关于旗下部分基金增加东方财富证券为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-31
15	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金申购费率优惠标准的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-08
16	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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-13
17	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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
18	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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-19
20	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金获配上海瀚讯（300762）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-01
21	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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-01
22	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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-13
23	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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-15
24	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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-21
25	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资	证券时报、基金管理	2021-06-11

	关联方承销证券的关联交易公告	人网站、中国证监会基金电子披露网站	
26	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公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-18
27	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金获配信立泰（002294）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-24
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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-25

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)的文件；
- 2、《南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》；
- 3、《南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)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、《南方养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)2021 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>