

南华瑞利债券型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:南华基金管理有限公司

基金托管人:华泰证券股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年08月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
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	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	20
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	20
6.1 资产负债表	20
6.2 利润表	22
6.3 净资产（基金净值）变动表	24
6.4 报表附注	26
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	49

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§9 开放式基金份额变动	53
§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南华瑞利债券型证券投资基金	
基金简称	南华瑞利债券	
基金主代码	011464	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年05月20日	
基金管理人	南华基金管理有限公司	
基金托管人	华泰证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,185,053,227.61份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南华瑞利债券A	南华瑞利债券C
下属分级基金的交易代码	011464	011465
报告期末下属分级基金的份额总额	1,184,671,592.27份	381,635.34份

注：本基金经中国证券监督管理委员会同意，并经基金份额持有人大会审议通过，自2022年3月28日起由“南华瑞利纯债债券型证券投资基金”变更为“南华瑞利债券型证券投资基金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，结合定量分析方法，确定资产配置比例。
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

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		南华基金管理有限公司	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴海燕	李欣然
	联系电话	010-58965800	025-83388339
	电子邮箱	services@nanhuafunds.com	lixinran@htsc.com
客户服务电话		400-810-5599	025-83389988/83389966
传真		010-58965908	025-83387215
注册地址		浙江省东阳市横店影视产业实验区商务楼	南京市江东中路228号
办公地址		浙江省杭州市上城区横店大厦801室	南京市江东中路228号
邮政编码		310008	210019
法定代表人		朱坚	张伟

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	www.nanhuafunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南华基金管理有限公司	浙江省杭州市上城区横店大厦801室

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	南华瑞利债券A	南华瑞利债券C
本期已实现收益	22,605,122.47	3,742,089.91
本期利润	32,185,720.94	2,503,125.16
加权平均基金份额本期利润	0.0193	0.0068
本期加权平均净值利润率	1.81%	0.64%
本期基金份额净值增长率	2.25%	0.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	43,169,594.27	-1,807.03
期末可供分配基金份额利润	0.0364	-0.0047
期末基金资产净值	1,240,874,236.22	383,858.54
期末基金份额净值	1.0474	1.0058
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	35.46%	30.84%

注：（1）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；

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

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南华瑞利债券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	0.82%	0.11%	-0.24%	0.03%	1.06%	0.08%
过去三个月	1.82%	0.12%	0.29%	0.04%	1.53%	0.08%
过去六个月	2.25%	0.09%	0.38%	0.05%	1.87%	0.04%
过去一年	2.26%	0.06%	1.83%	0.05%	0.43%	0.01%
自基金合同生效起至今	35.46%	1.97%	1.88%	0.05%	33.58%	1.92%

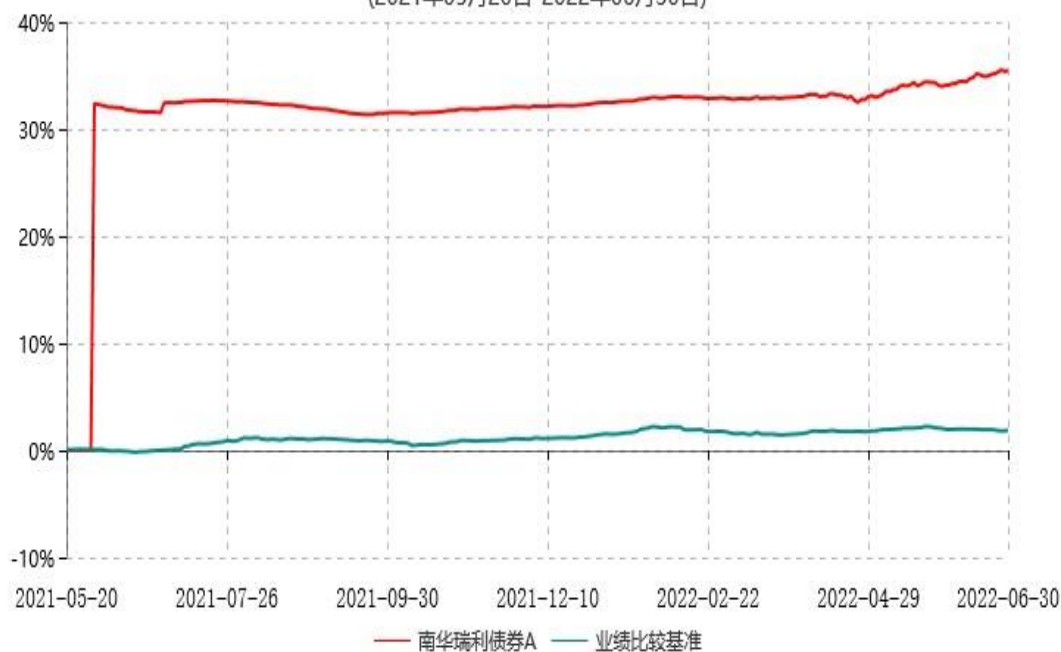
南华瑞利债券C

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	0.80%	0.11%	-0.24%	0.03%	1.04%	0.08%
过去三个月	0.37%	0.22%	0.29%	0.04%	0.08%	0.18%
过去六个月	0.75%	0.15%	0.38%	0.05%	0.37%	0.10%
过去一年	0.59%	0.11%	1.83%	0.05%	-1.24%	0.06%
自基金合同生效起至今	30.84%	1.83%	1.88%	0.05%	28.96%	1.78%

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

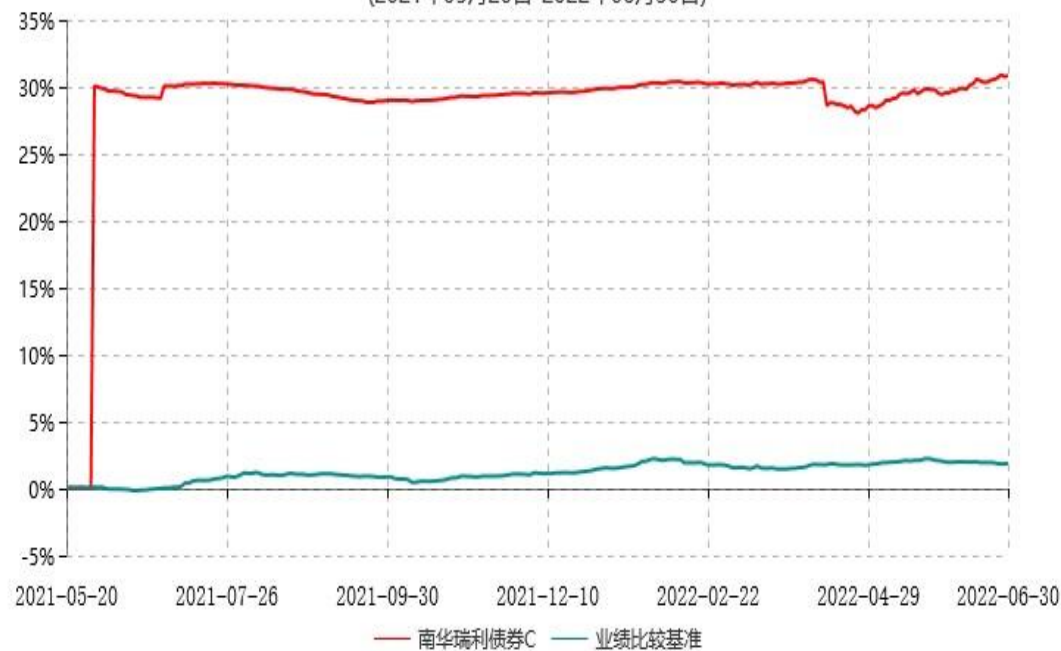
南华瑞利债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年05月20日-2022年06月30日)



南华瑞利债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年05月20日-2022年06月30日)



§ 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

南华基金管理有限公司于2016年10月18日经中国证监会核准设立，于2016年11月17日经工商注册登记成立，是国内第一家由期货公司全资控股的公募基金管理公司，股东为南华期货股份有限公司。公司注册资本2.0亿元，注册地为浙江省东阳市横店影视产业实验区商务楼。

截止报告期末，南华基金管理有限公司旗下共管理14只公募基金，分别为南华瑞盈混合型发起式证券投资基金、南华丰淳混合型证券投资基金、南华瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金、南华瑞扬纯债债券型证券投资基金、南华瑞恒中短债债券型证券投资基金、南华瑞元定期开放债券型发起式证券投资基金、南华价值启航纯债债券型证券投资基金、南华瑞泽债券型证券投资基金、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金、南华瑞利债券型证券投资基金、南华丰汇混合型证券投资基金及南华瑞诚一年定期开放债券型发起式证券投资基金，资产管理规模约104.61亿元。

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		
孙海龙	本基金基金经理	2021-05-20	2022-04-12	7	硕士研究生，具有基金从业资格。2014年7月至2015年6月在厦门国际银行股份有限公司发展研究部任研究员，2015年8月至2020年5月在天安人寿保险股份有限公司固定收益部任投资经理，2020年5月22日入职南华基金管理有限公司。曾任南华瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资

					基金基金经理（2020年7月3日至2022年4月12日任职）、南华瑞元定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2020年7月3日至2022年4月12日任职）、南华价值启航纯债债券型证券投资基金基金经理（2021年4月3日至2022年4月12日任职）、南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（2021年4月3日至2022年4月12日任职）、南华瑞泽债券型证券投资基金基金经理（2021年4月20日至2022年4月12日任职）、南华瑞利债券型证券投资基金基金经理（2022年3月28日至2022年4月12日任职，2021年5月20日至2022年3月27日任职南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金经理，南华瑞利纯债债券型证券投资基金后转型为南华瑞利债券型证券投资基金）
何林泽	本基金基金经理	2021-09-08	-	11	硕士研究生，具有基金从业资格。2011年6月28日至2020年11月09日，先后在兴证证券资产管理有限公司固定收益部，担任固定收益研究员、投资主办和副总经理职务。2020年11

				月10日至2021年4月14日，在建信信托有限责任公司，担任上海证券业务部负责人。2021年4月15日入职南华基金管理有限公司，现任南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（2021年4月28日起任职）、南华瑞泽债券型证券投资基金基金经理（2021年6月3日起任职）、南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金经理（2021年8月17日起任职）、南华瑞扬纯债债券型证券投资基金基金经理（2021年12月29日起任职）、南华瑞利债券型证券投资基金基金经理（2022年3月28日起任职，2021年9月8日至2022年3月27日任职南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金经理，南华瑞利纯债债券型证券投资基金后转型为南华瑞利债券型证券投资基金）、南华瑞诚一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2022年6月29日起任职）、南华瑞元定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2022年7月29日起任职）、南华瑞鑫定期开放债券型发起式证
--	--	--	--	---

					券投资基金基金经理（2022年7月29日起任职）。
康冬	本基金基金经理助理	2022-03-15	-	5	博士研究生，具有基金从业资格。曾先后工作于中航证券有限公司风险管理部和南华期货股份有限公司基金部，于2020年1月13日入职南华基金管理有限公司量化投资部，先后担任研究员、投资经理助理。曾任南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理（2022年3月15日至2022年8月26日止）、南华瑞泽债券型证券投资基金基金经理助理（2021年12月11日至2022年8月26日止）、南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金经理助理（2021年12月11日至2022年8月26日止）、南华瑞恒中短债债券型证券投资基金基金经理助理（2022年6月24日至2022年8月26日止）、南华瑞扬纯债债券型证券投资基金基金经理助理（2022年3月15日至2022年8月26日止）、南华丰淳混合型证券投资基金基金经理助理（2022年7月21日至2022年8月26日止）、南华瑞利债券型证券投资基金基金经理助理（2022年3月28日

					至2022年8月26日止，2022年3月15日至2022年3月27日任职南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金经理助理，南华瑞利纯债债券型证券投资基金后转型为南华瑞利债券型证券投资基金）。现任南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理（2021年12月11日起任职），南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理（2021年12月11日起任职）、南华丰汇混合型证券投资基金基金经理助理（2022年3月10日起任职）。
刘琦	本基金基金经理助理	2022-03-15	-	6	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任南华基金管理有限公司研究部研究员、固定收益部的基金经理助理。曾任南华瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理（2021年7月3日至2022年8月26日止）、南华价值启航纯债债券型证券投资基金基金经理助理（2021年7月3日至2022年8月26日止）、南华瑞元定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理（2021年7月3日

					至2022年8月26日止）、南华瑞扬纯债债券型证券投资基金基金经理助理（2021年9月8日至2022年8月26日止）、南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理（2022年2月16日至2022年8月26日止）、南华瑞利债券型证券投资基金基金经理助理（2022年3月28日起至2022年8月26日止，2022年3月15日至2022年3月27日任职南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金经理助理，南华瑞利纯债债券型证券投资基金后转型为南华瑞利债券型证券投资基金）、南华瑞泽债券型证券投资基金基金经理助理（2022年3月15日至2022年8月26日止）、南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金经理助理（2022年3月15日至2022年8月26日止）、南华瑞恒中短债债券型证券投资基金基金经理助理（2022年6月24日至2022年8月26日止）、南华瑞诚一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理（2022年6月30日至2022年8月26日止）。
陆越	本基金基金经理助理	2021-	-	3	硕士研究生，具有基金从

		09-16		业资格。曾任建信信托有限责任公司证券市场团队的投资经理助理，现任南华基金管理有限公司浙江分公司固定收益部的基金经理助理。现任南华瑞泽债券型证券投资基金基金经理助理（2021年7月3日起任职）、南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金经理助理（2021年8月19日起任职）、南华瑞利债券型证券投资基金基金经理助理（2022年3月28日起任职，2021年9月16日至2022年3月27日任职南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金经理助理，南华瑞利纯债债券型证券投资基金后转型为南华瑞利债券型证券投资基金）、南华瑞扬纯债债券型证券投资基金基金经理助理（2021年12月31日起任职）、南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理（2022年2月16日起任职）、南华瑞恒中短债债券型证券投资基金基金经理助理（2022年7月6日起任职）、南华瑞诚一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理（2022年7月6日起任职）、
--	--	-------	--	---

					南华丰淳混合型证券投资基金基金经理助理（2022年7月19日起任职）、南华瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理（2022年8月16日起任职）、南华瑞元定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理（2022年8月16日起任职）。
--	--	--	--	--	---

注：

- （1）基金经理孙海龙的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理何林泽的任职日期是指公司作出决定后公告之日；
- （2）基金经理孙海龙已于2022年4月12日离任，离任日期为公司作出决定后公告之日；
- （3）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；
- （4）本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南华瑞利债券型证券投资基金基金合同》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，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

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《南华基金管理有限公司公平交易管理细则》的规定，通过系统和人工等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投资组合。

在投资决策内部控制方面，本基金管理人确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度，通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式，使不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行控制方面，本基金管理人实行集中交易制度，交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先，价格优先的原则严格执行所有指令，确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易，按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

本报告期内，公司对不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合合同向交易的差价进行分析，未发现违反公平交易原则的异常情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制及监控制度，报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

2022年上半年，债券市场方面，一季度债券市场以春节为分界点，春节前利率小幅下行，春节后回升并震荡。春节前，央行下调OMO和MLF利率10bp，并表示“货币政策工具箱开得再大一些”，推动利率下行。春节后，海外美联储偏鹰，同时一月社融放量6万亿超预期，利率开始回调。二季度上海、北京等地局部疫情爆发，受疫情冲击影响，央行货币政策在二季度一直处于宽松状态，4月下旬再度降准0.25个百分点，短端利率快速下行，但长端利率整体波动水平呈收敛特征，二季度10年国债收益率在2.75-2.85%区间内窄幅波动。

基金操作层面，对于债券市场投资策略，在货币政策持续宽松的情况下，我们将适度进行杠杆操作获取相对确定的套息收益，同时我们将继续进行可转债品种的波段交易，获取增强收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末南华瑞利债券A基金份额净值为1.0474元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.25%，同期业绩比较基准收益率为0.38%；截至报告期末南华瑞利债券C基金份额净值为1.0058元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.75%，同期业绩比较基准收益率为0.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，随着疫情冲击影响逐步消退，复工复产持续推进，经济数据于底部企稳后回升。但疫情的发展存在不确定性，地产对经济拖累仍然较大，制造业投资可能会随着外需回落而走软。如果后续需求仍然疲软，地产也未看到显著积极信号，经济基本面

将重新回到依靠内生增长动力的路径中，届时需要密切关注经济基本面对债券市场影响的变化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金进行了 3 次收益分配，符合法律法规和基金合同规定。具体如下：

第 1 次收益分配：

A 类份额：权益登记日 2022 年 1 月 24 日，每 10 份基金份额派发红利 0.46 元。

C 类份额：权益登记日 2022 年 1 月 24 日，每 10 份基金份额派发红利 0.46 元。

第 2 次收益分配：

A 类份额：权益登记日 2022 年 2 月 24 日，每 10 份基金份额派发红利 0.40 元。

C 类份额：权益登记日 2022 年 2 月 24 日，每 10 份基金份额派发红利 0.40 元。

第 3 次收益分配：

A 类份额：权益登记日 2022 年 3 月 29 日，每 10 份基金份额派发红利 0.35 元。

C 类份额：权益登记日 2022 年 3 月 29 日，每 10 份基金份额派发红利 0.35 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人一华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支等方面进行了复核，未发现基金管理人存在损害本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

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金年度报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等内容，相关内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南华瑞利债券型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,133,638.33	58,502,352.44
结算备付金		31,023,108.24	323,010,775.48
存出保证金		105,049.11	70,735.04
交易性金融资产	6.4.7.2	1,457,464,768.44	1,837,156,906.90
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		1,457,464,768.44	1,837,156,906.90
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	29,028,558.99
资产总计		1,491,726,564.12	2,247,769,328.85
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		249,841,723.01	239,798,920.30
应付清算款		-	-
应付赎回款		5,630.47	335.51
应付管理人报酬		304,388.14	542,548.64
应付托管费		101,462.73	180,849.56
应付销售服务费		63.46	80,950.98
应付投资顾问费		-	-
应交税费		33,375.73	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	181,825.82	424,559.67
负债合计		250,468,469.36	241,028,164.66

净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,185,053,227.61	1,761,587,964.14
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	56,204,867.15	245,153,200.05
净资产合计		1,241,258,094.76	2,006,741,164.19
负债和净资产总计		1,491,726,564.12	2,247,769,328.85

注：报告截止日2022年06月30日，基金份额总额1,185,053,227.61份。其中南华瑞利债券基金A类基金份额净值1.0474元，基金份额总额1,184,671,592.27份；南华瑞利债券基金C类基金份额净值1.0058元，基金份额总额381,635.34份。

6.2 利润表

会计主体：南华瑞利债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年05月20日（基金 合同生效日）至2021 年06月30日
一、营业总收入		40,483,560.88	422,207.79
1. 利息收入		1,058,411.12	151,933.84
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,058,411.12	65,903.39
债券利息收入		-	3,116.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	82,913.49
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		31,074,239.81	-375.47
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6. 4. 7. 11	31, 074, 239. 81	-375. 47
资产支持证券投资 收益	6. 4. 7. 12	-	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 13	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 14	-	-
股利收益	6. 4. 7. 15	-	-
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. 7. 16	8, 341, 633. 72	136. 87
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6. 4. 7. 17	9, 276. 23	270, 512. 55
减：二、营业总支出		5, 794, 714. 78	78, 539. 40
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	3, 258, 590. 87	23, 927. 35
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	1, 086, 197. 02	7, 975. 78
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	398, 123. 03	15, 701. 16
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		873, 433. 99	-
其中：卖出回购金融资产 支出		873, 433. 99	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		6, 909. 72	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 18	171, 460. 15	30, 935. 11
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		34, 688, 846. 10	343, 668. 39

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,688,846.10	343,668.39
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		34,688,846.10	343,668.39

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南华瑞利债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06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）	1,761,587,96 4.14	-	245,153,200. 05	2,006,741,16 4.19
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）	1,761,587,96 4.14	-	245,153,200. 05	2,006,741,16 4.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-576,534,73 6.53	-	-188,948,33 2.90	-765,483,06 9.43
（一）、综合收益总额	-	-	34,688,846.1 0	34,688,846.1 0
（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）	-576,534,73 6.53	-	129,894,167. 96	-446,640,56 8.57

其中：1. 基金申购款	1, 505, 713, 62 0. 95	-	187, 871, 979. 45	1, 693, 585, 60 0. 40
2. 基金赎回款	-2, 082, 248, 3 57. 48	-	-57, 977, 811. 49	-2, 140, 226, 1 68. 97
（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）	-	-	-353, 531, 34 6. 96	-353, 531, 34 6. 96
（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）	1, 185, 053, 22 7. 61	-	56, 204, 867. 1 5	1, 241, 258, 09 4. 76
项 目	上年度可比期间 2021年05月20日（基金合同生效日）至2021年06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）	236, 549, 119. 01	-	-	236, 549, 119. 01
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）	236, 549, 119. 01	-	-	236, 549, 119. 01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-233, 188, 05 1. 47	-	1, 069, 321. 36	-232, 118, 73 0. 11
（一）、综合收益总额	-	-	343, 668. 39	343, 668. 39
（二）、本期基金份额交易产生的基金	-233, 188, 05 1. 47	-	725, 652. 97	-232, 462, 39 8. 50

净值变动数(净值减少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	6, 182, 845. 00	-	1, 844, 507. 59	8, 027, 352. 59
2. 基金赎回款	-239, 370, 89 6. 47	-	-1, 118, 854. 6 2	-240, 489, 75 1. 09
(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)	3, 361, 067. 54	-	1, 069, 321. 36	4, 430, 388. 90

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:

朱坚

连省

母学贤

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 基金基本情况

南华瑞利纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)[2020]3702号《关于准予南华瑞利纯债债券型证券投资基金注册的批复》注册,由南华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币236,538,479.96元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0519号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金合同》于2021年5月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为236,549,119.01份基金份额,其中认购资金利息折合10,639.05份基金份额。本基金的基金管理人为南华基金管理有限公司,基金托管人为华泰证券股份有限公司。2022年2月10日,经中国证监会《关于准予南华瑞利纯债债券型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可【2022】307

号文) 准予变更注册。2022 年 2 月 25 日至 2022 年 3 月 25 日期间, 南华瑞利纯债债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会, 会议审议通过了《关于修改南华瑞利 纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》, 主要包括南华瑞利纯债债券型证券投资基金调整投资范围、投资策略、估值方法等内容, 并同意将“南华 瑞利纯债债券型证券投资基金”更名为“南华瑞利债券型证券投资基金”。上述 基金合同修订事项已于 2022 年 3 月 28 日经基金份额持有人大会决议表决生效。自 2022 年 3 月 28 日起, 修订后的《南华瑞利债券型证券投资基金基金合同》生 效。

根据《南华瑞利债券型证券投资基金招募说明书》, 本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同, 将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的基金份额, 称为A类基金份额; 不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用, 且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额, 称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同, 本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南华瑞利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行和上市 交易的债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期 融资券、超短期融资券、次级债、政府支持机构债、地方政府债、可转换债券(含 可分离交易可转债)、可交换债券、证券公司短期公司债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金不投资股票, 但可持有因可转债、可交换债转股所形成的股票等。因上述原因持有的股票等资产, 本基金应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围, 并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的投资组合比例为: 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。每个交易日日终, 在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后, 持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制, 基金管理人在履行适当程序后, 可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为中债综合(全价)指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人南华基金管理有限公司于2022年8月30日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南华瑞利债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

除下文6.4.5.1会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年01月01日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用该准则。

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息，金额分别为58,502,352.44元、323,010,775.48元、70,735.04元和29,028,558.99元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和其他资产—应收利息，金额分别为58,526,385.01元、323,110,960.72元、70,743.32元和0.00元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为1,837,156,906.90元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为1,866,061,239.80元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为239,798,920.30元、335.51元、542,548.64元、180,849.56元、80,950.98元、7,894.70元、252,164.97元和164,500.00元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为240,051,085.27元、335.51元、542,548.64元、180,849.56元、80,950.98元、7,894.70元、0.00元和164,500.00元。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	3,133,638.33
等于：本金	3,131,337.98
加：应计利息	2,300.35
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	3,133,638.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	—	—	—	—

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	303,275,029.22	820,181.64	313,569,269.27	9,474,058.41
	银行间市场	1,120,756,805.49	18,061,499.17	1,143,895,499.17	5,077,194.51
	合计	1,424,031,834.71	18,881,680.81	1,457,464,768.44	14,551,252.92
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,424,031,834.71	18,881,680.81	1,457,464,768.44	14,551,252.92

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
应付交易费用	24,865.67
其中：交易所市场	-
银行间市场	24,865.67
应付利息	-
预提费用	156,960.15
合计	181,825.82

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 南华瑞利债券A

金额单位：人民币元

项目 (南华瑞利债券A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,373,074,961.66	1,373,074,961.66
本期申购	1,027,318,726.90	1,027,318,726.90
本期赎回（以“-”号填列）	-1,215,722,096.29	-1,215,722,096.29
本期末	1,184,671,592.27	1,184,671,592.27

6.4.7.7.2 南华瑞利债券C

金额单位：人民币元

项目 (南华瑞利债券C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	388,513,002.48	388,513,002.48
本期申购	478,394,894.05	478,394,894.05
本期赎回（以“-”号填列）	-866,526,261.19	-866,526,261.19
本期末	381,635.34	381,635.34

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 南华瑞利债券A

单位：人民币元

项目 (南华瑞利债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	197,379,808.06	1,569,477.48	198,949,285.54
本期利润	22,605,122.47	9,580,598.47	32,185,720.94
本期基金份额交易产生的变动数	88,929,221.50	1,882,973.73	90,812,195.23
其中：基金申购款	128,979,333.94	2,286,184.13	131,265,518.07
基金赎回款	-40,050,112.44	-403,210.40	-40,453,322.84
本期已分配利润	-265,744,557.76	-	-265,744,557.76
本期末	43,169,594.27	13,033,049.68	56,202,643.95

6.4.7.8.2 南华瑞利债券C

单位：人民币元

项目 (南华瑞利债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	45,772,205.82	431,708.69	46,203,914.51
本期利润	3,742,089.91	-1,238,964.75	2,503,125.16
本期基金份额交易产生的变动数	38,270,686.44	811,286.29	39,081,972.73
其中：基金申购款	55,291,261.20	1,315,200.18	56,606,461.38
基金赎回款	-17,020,574.76	-503,913.89	-17,524,488.65
本期已分配利润	-87,786,789.20	-	-87,786,789.20
本期末	-1,807.03	4,030.23	2,223.20

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	980,813.38
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	65,868.34
其他	11,729.40
合计	1,058,411.12

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	23,211,145.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	7,863,094.10
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	31,074,239.81

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,110,646,688.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,064,725,603.71
减：应计利息总额	37,733,857.49
减：交易费用	324,133.23

买卖债券差价收入	7,863,094.10
----------	--------------

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

无。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	8,341,633.72
——股票投资	—
——债券投资	8,341,633.72
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
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	8,341,633.72

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	9,276.23
合计	9,276.23

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
银行间账户维护费	12,200.00
公证费	20,000.00
律师费	50,000.00
合计	171,460.15

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
南华基金管理有限公司(“南华基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金托管人
南华期货股份有限公司(“南华期货公司”)	基金管理人的股东、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年05月20日（基金合同 生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,258,590.87	23,927.35

其中：支付销售机构的客户维护费	151,496.48	298.20
-----------------	------------	--------

注：支付基金管理人南华基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%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×0.30%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年05月20日（基金合同生 效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,086,197.02	7,975.78

注：支付基金托管人华泰证券的托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南华瑞利债券A	南华瑞利债券C	合计
南华期货 公司	0.00	0.00	0.00
南华基金	0.00	226,417.82	226,417.82
华泰证券	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	226,417.82	226,417.82
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2021年05月20日（基金合同生效日）至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南华瑞利债券A	南华瑞利债券C	合计
南华期货	0.00	0.00	0.00

公司			
南华基金	0.00	15,521.45	15,521.45
华泰证券	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	15,521.45	15,521.45

注：支付基金销售机构的销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南华基金，再由南华基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日C类基金份额销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年05月20日（基金合同生效日） 至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华泰证券股份有限公司	3,133,638.33	980,813.38	877,510.70	64,111.90

注：本基金托管户的银行存款由基金托管人华泰证券股份有限公司存放在中国工商银行南京奥体支行。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

南华瑞利债券A

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2022-01-24	2022-01-24	0.460	53,592,284.58	40,514,641.40	94,106,925.98	-
2	2022-02-24	2022-02-24	0.400	55,654,282.91	36,699,118.42	92,353,401.33	-
3	2022-03-29	2022-03-29	0.350	45,963,560.47	33,320,669.98	79,284,230.45	-
合计			1.210	155,210,127.96	110,534,429.80	265,744,557.76	-

南华瑞利债券C

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2022-01-24	2022-01-24	0.460	38,381,538.99	538.76	38,382,077.75	-
2	2022-02-24	2022-02-24	0.400	34,672,581.72	491.65	34,673,073.37	-
3	2022-03-29	2022-03-29	0.350	14,731,313.06	325.02	14,731,638.08	-
合计			1.210	87,785,433.77	1,355.43	87,786,789.20	-

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年06月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额249,841,723.01元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
2028024	20中信银行二级	2022-07-07	105.69	400,000	42,277,113.42
2128028	21邮储银行二级01	2022-07-07	103.26	130,000	13,424,111.29
2128036	21平安银行二级	2022-07-07	103.36	800,000	82,685,071.78
2128042	21兴业银行二级02	2022-07-07	102.88	600,000	61,727,799.45
2228017	22邮储银行二级01	2022-07-07	101.60	700,000	71,121,591.78
合计				2,630,000	271,235,687.72

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制投资风险和保持资金流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。

本基金的基金管理人建立了全面风险管理体系，在董事会下设立风险控制委员会，根据公司总体战略负责拟订公司风险战略和风险管理政策，并对其实施情况及效果进行监督和评价，指导公司的风险管理和内控制度建设；对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估；监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评估公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和通行的会计标准。在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责制定公司经营管理中的风险控制政策，组织制定公司经营管理中的内部风险控制制度；对公司在投资、市场、信用、操作等方面的风险控制情况进行监督；以及对公司经营管理过程中的风险状况进行定期或不定期评估。在业务操作层面，监察稽核部负责公司旗下基金及其它受托资产投资中的风险识别、评估和控制并承担其他风险的管理职责，负责在各业务部门一线风险控制的基础上实施风险再控制。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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、日常的量化报告等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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金托管人华泰证券股份有限公司的托管账户，开立于中国工商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	64,054,883.04	-
合计	64,054,883.04	-

注：未评级债券为国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	924,248,003.90	-
AAA以下	162,375,148.89	-
未评级	306,786,732.61	-
合计	1,393,409,885.40	-

注：未评级债券为国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的长期信用债券。

6.4.13.3 流动性风险

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托管人华泰证券股份有限公司的托管账户，开立在中国工商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2022年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有249,841,723.01元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期

日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。

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7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不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，本基金的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本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 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	3,133,638.33	-	-	-	3,133,638.33
结算备付金	-	-	-	31,023,108.24	31,023,108.24
存出保证金	105,049.11	-	-	-	105,049.11
交易性金融资产	64,054,883.04	1,283,776,572.81	109,633,312.59	-	1,457,464,768.44
资产总计	67,293,570.48	1,283,776,572.81	109,633,312.59	31,023,108.24	1,491,726,564.12
负债					
卖出回购金融资产款	249,841,723.01	-	-	-	249,841,723.01
应付赎回款	-	-	-	5,630.47	5,630.47
应付管理人报酬	-	-	-	304,388.14	304,388.14
应付托管费	-	-	-	101,462.73	101,462.73
应付销售服务	-	-	-	63.46	63.46

南华瑞利债券型证券投资基金 2022 年中期报告

费					
应交税费	-	-	-	33,375.73	33,375.73
其他负债	-	-	-	181,825.82	181,825.82
负债总计	249,841,723.01	-	-	626,746.35	250,468,469.36
利率敏感度缺口	-182,548,152.53	1,283,776,572.81	109,633,312.59	30,396,361.89	1,241,258,094.76
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	58,502,352.44	-	-	-	58,502,352.44
结算备付金	323,010,775.48	-	-	-	323,010,775.48
存出保证金	70,735.04	-	-	-	70,735.04
交易性金融资产	944,223,906.90	728,422,000.00	164,511,000.00	-	1,837,156,906.90
应收利息	-	-	-	29,028,558.99	29,028,558.99
资产总计	1,325,807,769.86	728,422,000.00	164,511,000.00	29,028,558.99	2,247,769,328.85
负债					
卖出回购金融资产款	239,798,920.30	-	-	-	239,798,920.30
应付赎回款	-	-	-	335.51	335.51
应付管理人报酬	-	-	-	542,548.64	542,548.64
应付托管费	-	-	-	180,849.56	180,849.56
应付销售服务费	-	-	-	80,950.98	80,950.98
应付交易费用	-	-	-	7,894.70	7,894.70

应付利息	-	-	-	252,164.97	252,164.97
其他负债	-	-	-	164,500.00	164,500.00
负债总计	239,798,920.30	0.00	0.00	1,229,244.36	241,028,164.66
利率敏感度缺口	1,086,008,849.56	728,422,000.00	164,511,000.00	27,799,314.63	2,006,741,164.19

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率下降25个基点	9,233,712.78	9,196,968.80
	市场利率上升25个基点	-9,129,081.04	-9,005,581.83

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	289,967,317.74	-
第二层次	1,167,497,450.70	1,837,156,906.90
第三层次	-	-
合计	1,457,464,768.44	1,837,156,906.90

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,457,464,768.44	97.70
	其中：债券	1,457,464,768.44	97.70
	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	34,156,746.57	2.29
8	其他各项资产	105,049.11	0.01
9	合计	1,491,726,564.12	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

无。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	64,054,883.04	5.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	632,829,932.58	50.98
	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	470,612,635.08	37.91
7	可转债(可交换债)	289,967,317.74	23.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,457,464,768.44	117.42

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	占基金资产净值比例(%)
1	102101386	21中石化MTN001	1,000,000	103,607,643.84	8.35
2	2128025	21建设银行二级01	900,000	93,120,780.82	7.50
3	102280281	22深航空MTN001	900,000	91,063,444.93	7.34
4	2128036	21平安银行二	800,000	82,685,071.7	6.66

		级		8	
5	2128039	21中国银行二 级03	700,000	72,128,786.3 0	5.81

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

本基金本报告期内未进行股指期货的投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货的投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 本基金为债券型基金，不投资股票、权证、可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券等资产，因此不存在投资超出基金合同规定的备选股票库之外的股票的情形。

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
1	存出保证金	105,049.11
2	应收清算款	—

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	105,049.11

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	占基金资产净值比例 (%)
1	127045	牧原转债	47,474,003.51	3.82
2	113044	大秦转债	32,717,424.66	2.64
3	110073	国投转债	32,707,709.75	2.64
4	113037	紫银转债	26,060,643.65	2.10
5	113046	金田转债	24,009,721.68	1.93
6	127005	长证转债	23,147,583.56	1.86
7	128129	青农转债	21,922,166.80	1.77
8	110057	现代转债	9,655,418.65	0.78
9	110047	山鹰转债	5,655,493.15	0.46
10	113052	兴业转债	5,583,576.71	0.45
11	110063	鹰19转债	4,457,843.25	0.36

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 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
南华 瑞利 债券A	417	2,840,939.07	1,184,011,604.37	99.94%	659,987.90	0.06%
南华 瑞利 债券C	304	1,255.38	0.00	0.00%	381,635.34	100.00%
合计	721	1,643,624.45	1,184,011,604.37	99.91%	1,041,623.24	0.09%

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	南华瑞利债券A	138.73	0.0000%
	南华瑞利债券C	—	—
	合计	138.73	0.0000%

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

期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人以及本基金基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	南华瑞利债券A	南华瑞利债券C
基金合同生效日(2021年05月20日)基金份额总额	71,589.19	236,477,529.82

本报告期期初基金份额总额	1, 373, 074, 961. 66	388, 513, 002. 48
本报告期基金总申购份额	1, 027, 318, 726. 90	478, 394, 894. 05
减：本报告期基金总赎回份额	1, 215, 722, 096. 29	866, 526, 261. 19
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1, 184, 671, 592. 27	381, 635. 34

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金共召开两次持有人大会，相关情况如下：

一、

2022年2月1日至2022年3月1日，南华瑞利纯债债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会。根据计票结果，本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的南华瑞利债券型证券投资基金基金份额未达到在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一），不符合本次基金份额持有人大会的召开条件，故本次基金份额持有人大会召开失败。具体情况请参见基金管理人于2022年3月5日公布的《南华基金管理有限公司关于南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

二、

2022年2月25日至2022年3月25日，南华瑞利纯债债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议了《关于修改南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，相关决议自2022年3月28日起生效。

具体情况请参见基金管理人于2022年3月30日公布的《南华基金管理有限公司关于南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》及同日公布的《南华基金管理有限公司关于变更南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金名称并修改基金合同及托管协议相应条款的公告》等相关文件。

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，王明德先生于2022年6月27日起不再担任本基金管理人南华基金管理有限公司的副总经理。前述人事变动已按规定进行备案并公告。

本报告期内，本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，无涉及本基金基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，产品投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的会计师事务所无变化。

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，本基金基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
华安证券	2	-	-	294,783.36	100.00%	-

注：

1、交易单元的选择标准：

- (1) 证券经营机构经营业务全面，资质雄厚，信誉良好且财务状况良好；
- (2) 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，建立相关业务利益冲突防范机制，完善隔离墙制度，确保研究、投行服务客观公正，并能满足基金资金投资运作高度保密的要求；
- (3) 研究实力强，有独立的研究部门，能提供宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、推荐模拟组合、债券分析报告、个股分析报告及其他专门报告。

2、证券交易单元选择程序由基金管理人研究部发起立项申请，并联合相关部门根据评分标准对拟选择证券经营机构从不同角度进行评估、打分；研究部汇总评分结果，呈报公司领导审批后，基金管理人与选定证券经营机构签订证券交易单元租用协议。

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		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
华安证券	1,484,818,606.03	100.00%	-	-	-	-	-	-

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	南华瑞利纯债债券型证券投资基金恢复大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-01-05
2	南华瑞利纯债债券型证券投资基金分红公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-01-21
3	南华瑞利纯债债券型证券投资基金2021年第4季度报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-01-21
4	南华基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金2021年第4季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站、上海证券交易所网站	2022-01-21
5	南华基金管理有限公司关于南华瑞利纯债债券型证券投资基金新增国泰君安证券股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-01-26
6	南华基金管理有限公司关于以通讯方式召开南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-01-27
7	南华基金管理有限公司关于	证券时报、中国证监会基金	2022-01-28

	以通讯方式召开南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	电子披露网站、基金管理人网站	
8	南华基金管理有限公司关于以通讯方式召开南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-01-29
9	南华瑞利纯债债券型证券投资基金分红公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-02-23
10	南华基金管理有限公司关于以通讯方式召开南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-02-24
11	南华基金管理有限公司关于以通讯方式召开南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-02-25
12	南华基金管理有限公司关于以通讯方式召开南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-02-26
13	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增华龙证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-04
14	南华基金管理有限公司关于南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-05

	会议情况的公告		
15	南华基金管理有限公司 关于聘任基金经理助理的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-15
16	南华基金管理有限公司 关于聘任基金经理助理的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-15
17	南华瑞利纯债债券型证券投资基金分红公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-26
18	南华瑞利债券型证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-30
19	南华瑞利债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-30
20	南华瑞利债券型证券投资基金招募说明书(更新)2022年第1号	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-30
21	南华瑞利债券型证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-30
22	南华基金管理有限公司关于变更南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金名称并修改基金合同及托管协议相应条款的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-30
23	南华基金管理有限公司关于南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-30
24	南华基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金 2021年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站、上海证券	2022-03-30

		交易所网站	
25	南华瑞利纯债债券型证券投资基金 2021年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-03-30
26	南华基金管理有限公司关于南华瑞利债券型证券投资基金新增北京中植基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站、上海证券交易所网站	2022-04-06
27	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增财咨道信息技术有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-04-08
28	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增交通银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-04-11
29	南华瑞利债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-04-12
30	南华瑞利债券型证券投资基金招募说明书2022年第2号	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-04-15
31	南华瑞利债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-04-15
32	南华基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金 2022年第1季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站、上海证券交易所网站	2022-04-20
33	南华瑞利债券型证券投资基金2022年第1季度报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-04-20
34	南华基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证券报、	2022-04-28

	终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	
35	南华基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-04-29
36	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-05-18
37	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与申万宏源证券有限公司及申万宏源西部证券有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2022-06-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022/1/1-2022/6/30	880,729,801.14	103,665,865.83	-	984,395,666.97	83.07%
产品特有风险							
基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括： (1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险； (2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险； (3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险； (4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权； (5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。							

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) 中国证监会准予南华瑞利纯债债券型证券投资基金变更注册为南华瑞利债券型证券投资基金的批复文件；

(2) 《南华瑞利债券型证券投资基金基金合同》；

(3) 《南华瑞利债券型证券投资基金招募说明书》；

(4) 《南华瑞利债券型证券投资基金托管协议》；

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；

(6) 报告期内南华瑞利债券型证券投资基金在指定报刊披露的各项公告原稿。

12.2 存放地点

杭州市上城区横店大厦801室南华基金管理有限公司

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查询，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：www.nanhuafoods.com

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人南华基金管理有限公司，咨询电话400-810-5599。

南华基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日