

山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:山西证券股份有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 29 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月25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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年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	7
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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
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	50
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	50
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 期末上市基金前十名持有人	52

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
8.4 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.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
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.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	山证红利ETF
场内简称	山证红利ETF
基金主代码	515570
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年01月17日
基金管理人	山西证券股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	38,443,862.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020年04月09日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略跟踪标的指数，实现基金投资目标。但在因特殊情况导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。具体策略包括：投资组合管理、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借策略。
业绩比较基准	中证红利潜力指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，同时本基金为交易型开放式

	指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	--

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		山西证券股份有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛永红	许俊
	联系电话	95573	010-66596688
	电子邮箱	xueyonghong@sxzq.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		95573	95566
传真		0351-8686667	010-66594942
注册地址		山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		030002	100818
法定代表人		王怡里	葛海蛟

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://publiclyfund.sxzq.com:8000
基金中期报告备置地点	山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日- 2023年06月30日)
本期已实现收益	750,669.44
本期利润	-23,501.28
加权平均基金份额本期利润	-0.0006
本期加权平均净值利润率	-0.05%
本期基金份额净值增长率	0.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)
期末可供分配利润	5,852,126.42
期末可供分配基金份额利润	0.1522
期末基金资产净值	44,295,988.42
期末基金份额净值	1.1522
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	15.22%

注：1、本基金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、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、所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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去一个月	4.14%	0.97%	2.85%	1.03%	1.29%	-0.06%
过去三个月	-3.85%	0.98%	-5.24%	1.03%	1.39%	-0.05%
过去六个月	0.27%	0.98%	-1.34%	1.02%	1.61%	-0.04%
过去一年	-6.52%	1.10%	-11.49%	1.19%	4.97%	-0.09%
过去三年	14.46%	1.20%	4.22%	1.29%	10.24%	-0.09%
自基金合同生效起至今	15.22%	1.24%	0.95%	1.34%	14.27%	-0.10%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中证红利潜力指数收益率。

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

山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年01月17日-2023年06月30日)



1、按基金合同和招募说明书的约定，本基金建仓期为自基金合同生效之日起六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§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

山西证券股份有限公司最早成立于1988年7月，是全国首批证券公司之一，属国有控股性质。经过三十多年的发展，已成为作风稳健、经营稳定、管理规范、业绩良好的证券公司。2010年10月，公司上市首发申请获中国证监会发审委审核通过，11月15日正式在深圳证券交易所挂牌上市，股票代码002500，注册资本3,589,771,547元。

公司股东资金实力雄厚，经营风格稳健，资产质量优良，盈利能力良好，其构成集中体现多种优质资源、多家优势企业的强强联合。公司控股股东为山西金融投资控股集团有限公司。

山西证券的经营范围基本涵盖了所有的证券领域，分布于财富管理、企业金融、资产管理、FICC、权益、国际业务等板块，具体包括：证券经纪；证券自营；证券资产管理；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券；代销金融产品等。同时，公司具备公开募集证券投资基金管理业务资格，并获批开展债券质押式报价回购交易、股票质押式回购交易、约定购回式证券交易、转融通、上市公司股权激励行权融资、直接投资、柜台市场、基金投资顾问、场外期权、银行间债券市场尝试做市、债券通做市、非金融企业债务融资工具承销等业务。

公司控股中德证券有限责任公司，致力于提供广泛的股票、债券的承销与保荐，以及并购重组等顾问服务；全资控股山证（上海）资产管理有限公司，致力于证券资产管理、公募基金管理等业务拓展，提供覆盖所有客群、多资产、多策略、多市场的产品选择，为投资者提供一站式产品服务；全资控股格林大华期货有限公司，致力于提供期货经纪、投资咨询业务及财富管理、资产管理、风险管理、中间业务等全方位、全产业链的金融服务；全资控股山证投资有限责任公司，致力于为具备风险承受能力的高净值个人和机构提供财富管理服务，同时向优质企业提供资金支持，协助被投资企业通过并购重组、IPO上市等途径做优做强；全资控股山证创新投资有限公司，致力于把握市场趋势，挖掘资产价值，聚焦战略新兴产业，运用多元化投资手段，构建优质资产组合；全资控股并在香港设立山证国际金融控股有限公司，致力于为客户提供专业、优质、多元化、一站式的环球证券、期货及期权产品投资，环球资产配置、企业海外融资及并购服务；全资控股山证科技（深圳）有限责任公司，致力于计算机软件开发、信息系统软件开发、信息技术咨询、数据管理等信息技术服务，将大数据、云计算和人工智能技术与证券金融业务深度融合，探索证券行业金融科技发展的新模式，提升公司的行业核心竞争力。

公司设有分公司15家，营业部114家，期货营业网点25家，以上网点分布于山西各地市、主要县区及北京、上海、香港、天津、深圳、重庆、大连、济南、西安、宁波、长沙、福州、厦门、昆明、海口等地，形成了以国内主要城市为前沿，重点城市为中心，覆盖山西、面向全国的业务发展框架，为200余万客户提供全面、优质、专业的综合金融服务。

近年来，公司先后获得山西省政府颁发的“优秀中介机构”、深交所颁发的“中小企业板优秀保荐机构”、中国证监会颁发的“账户规范先进集体”等荣誉，并连续多年荣获山西省人民政府授予的“支持山西地方经济发展贡献奖”、“支持山西转型跨越发展-突出贡献奖”，山西省总工会授予的“山西省金融系统五一劳动奖章”、“山西省金融系统优质服务先进单位”，连续多年荣获中国扶贫基金会授予的“杰出贡献奖”。2019年，公司荣获山西省总工会授予的“标兵单位”，深交所授予的“优秀债券投资交易机构”、“优秀固定收益业务创新机构”，上海票据交易所授予的“优秀非银行类交易商”等荣誉；2020年，公司荣获山西省总工会金融工委授予的“山西省金融系统金融先锋号”，中央金融团工委授予的“2019年度全国金融系统五四红旗团委”，深圳证券交易所授予的“2019年优秀债券投资交易机构、优秀固定收益业务创新机构”，上海票据交易所授予的“优秀非银行类交易商”，中国外汇交易中心授予的“2019年度银行间本币市场核心交易商、优秀债券市场交易商”等荣誉；2021年，公司荣获中共山西省委授予的“全省先进基层党组织”，中国人民银行，中国证监会授予的“金融科技发展奖”，深圳证券交易所授予的“2020年度债券交易机制优化积极贡献奖”，深圳证券交易所授予的“主板上市公司2020年度信息披露考核A级”，上海证券交易所授予的“2020年度债券优秀交易商”，全国银行间同业拆借中心授予的“2020年度银行间本币市场核心交易商、优秀债券市场交易商、交易机制创新奖”，中国金融期货交易所授予的“国债期货优秀案例奖”，中国证券业协会、中国期货业协会、中国证券投资基金业协会、中国支付清算协会、中国互联网金融协会联合授予的“2020年度证券公司企业标准领跑者”，中国银行业协会和中国中小企业协会授予的“金融服务中小微企业优秀案例奖”，彭博 Bloomberg 授予的“2021首届中国区彭博量化大赛特等奖”，山西证监局授予的“2020年度综合贡献奖”等荣誉，公司实体投资者教育基地被中国证监会命名为“全国证券期货投资者教育基地”；2022年，公司荣获共青团中央授予的“全国五四红旗团委”，中共山西省委授予的“省直机关优秀党建品牌”，中国证监会授予的“证券期货信息技术应用创新优秀单位”，深圳证券交易所授予的“优秀利率债承销机构”，上海证券交易所授予的“债券优秀交易商”，中央结算公司授予的“债券投资交易类自营结算100强”、全国银行间同业拆借中心授予的“市场影响力奖”、“市场创新奖”、“银行间本币市场核心交易商”、“优秀债券市场交易商”、“交易机制创新奖”，中国上市公司协会授予的“2022年度ESG优秀上市公司”、“2022年上市公司监事会最佳实践案例”等荣誉，“公司主导完成的山西路桥、北方铜业重大标杆项目”入选山西经济日报评选的“2021年山西十大经济新闻”。

未来的山西证券将以“专业服务、创造价值”为使命，“以义制利、协作包容、追求卓越”的核心价值观，培育务实高效、恪尽职守的工作作风，营造和谐宽松、风清气正的公司氛围，坚定公司发展过程中差异化、一体化、平台化、数字化的战略实施路径，

打造公司与客户共同发展的平台，努力把公司建设成为有特色、有品牌、有竞争力的一流投资银行。

2014年3月19日，经中国证监会核准（证监许可【2014】319号），山西证券股份有限公司成为首批获得公开募集证券投资基金管理业务资格的证券公司。截至报告期末，山西证券股份有限公司旗下管理山西证券日日添利货币市场基金、山西证券裕利定期开放债券型发起式证券投资基金、山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金、山西证券改革精选灵活配置混合型证券投资基金、山西证券超短债债券型证券投资基金、山西证券裕泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、山西证券裕睿6个月定期开放债券型证券投资基金、山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金、山西证券裕桓一年持有期混合型发起式证券投资基金、山西证券裕丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、山西证券品质生活混合型证券投资基金、山西证券90天滚动持有短债债券型证券投资基金、山西证券裕享增强债券型发起式证券投资基金、山西证券裕辰债券型发起式证券投资基金、山西证券裕景30天持有期债券型发起式证券投资基金、山西证券裕泽债券型发起式证券投资基金、山西证券裕鑫180天持有期债券型发起式证券投资基金、山西证券丰盈180天滚动持有中短债债券型证券投资基金共18只公募基金。

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		
章海默	本基金的基金经理	2020-01-17	-	20年	章海默女士,复旦大学管理学院工商管理硕士,具有基金从业资格。2003年进入华安基金管理有限公司,2009年12月至2012年12月任华安上180ETF以及联接基金基金经理助理,2011年9月至2012年12月任华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金经理,2012年12月至2015年9月任华安上证180交

					<p>易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金经理，2013年6月至2015年9月任华安基金指数与量化投资部总监助理，2013年12月至2015年9月任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2014年11月至2015年9月任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2015年9月入西部证券股份有限公司上海第一分公司，2016年1月至2018年1月，于西部证券股份有限公司上海第一分公司负责投资管理公司港股自营投资账户；2018年3月至今，任山西证券公募基金部研究总监。2020年1月17日至今担任山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年6月9日至今担任山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（自2022年8月24日起转型为山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金）基金经理。</p>
崔大伟	基金经理助理	2023-04-24	-	7年	崔大伟先生，华中科技大学土木工程学士，上海财经大学金融硕士，2018年7

					月至2019年8月在恒越基金管理有限公司担任量化研究员；2020年9月加入山西证券公募基金部任量化研究员。
--	--	--	--	--	---

- 1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为本基金管理人对外披露的离任日期；
- 2、除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别为本基金管理人对外披露的任职日期和离任日期；
- 3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《公募基金管理业务公平交易管理细则》、《公募基金管理业务集中交易管理细则》、《公募基金管理业务异常交易管理细则》，对公司公募基金管理业务的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。公司公募基金管理业务建立了投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。公司公募基金管理业务拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等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可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易，未出现清算不到位的情况，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

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

管理人在去年年报中提到，尽管2022年的A股市场总体上令人失望，但展望2023年，管理人认为希望就在前方。新的一年是有望获取绝对收益的一年，随着疫情高峰的过去，在医疗资源、救治经验、医治手段不断完善及充裕的过程中，中国经济有望重新回到合理的发展轨道上，进而带动估值处于历史较低水平的A股市场出现明显的修复性机会。2023年A股市场仍处在细心耕耘可有收获的阶段，但同样的市场的波动相较于2021年来说仍充满挑战。

在2023年初，ChatGPT的涌现，以及随之而来的算力新一轮基础建设投资浪潮就在短短一个季度中扑面而来。人工智能是一个较长的产业链，涉及算法、算力和数据，亦涉及后续的应用，具备持续发酵和主题投资的基础。我们相信，这一轮算力的投资，不仅仅带动的是光模块、基板、电源以及冷却等硬件投资升级，更多的会引发半导体芯片的先进制程以及封装工艺再一次逼近极限。算力的提升依靠堆叠，而堆叠会依赖先进制程以及封装工艺。在此过程中，会有一批公司以及个股为之受益并有所表现。

由于红利潜力的Smart beta模型的选择效应，我们相信，会有越来越多的新一轮优秀公司，被选入成分股中，继续为投资者展现稳健而优秀的基金净值表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末山证红利ETF基金份额净值为1.1522元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.27%，同期业绩比较基准收益率为-1.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

就A股而言，由于人工智能的核心标的本质是匮乏的，因而市场处将一方面于不断的寻找新的赛道之中，一方面集中汇集于A股标的。如盈利以及订单进一步验证（因受制于全球订单以及产能节奏），则或将形成下一代核心资产的初步趋势。

另外，在下半年，我们也会关注通胀以及部分商品价格的走势，以厘定对应的资金价格中枢。但基于我们对于历史的回顾及研究，我们相信，无论国内国外，新一轮的技术革命以及创新周期的萌芽正在形成中，在稳健的资金环境下，将更有利于检验什么才是可持续的新一代核心资产。

由于红利潜力Smart beta模型的配置原理，因此在上述产业周期阶段，也将是指数吐故纳新，进一步跟踪优秀公司配置的阶段。管理人会继续努力，力争在波动加大的市场中为本基金的持有人带来更好的回报。

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新准则、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。

同时，由具备丰富专业知识、两年以上相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金会计负责估值工作。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

本基金收益分配原则：（1）本基金收益分配方式采用现金方式；（2）每一基金份额享有同等分配权；（3）当基金份额净值增长率超过同期标的指数同期增长率达到1%以上，方可对超额收益进行分配。在收益评价日，基金管理人就基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算；（4）基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；（5）本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配；（6）基金合同生效日起不满3个月可不进行收益分配；

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人，出现连续二十个工作日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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券

投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,052,680.69	1,351,709.47
结算备付金		46,458.93	83,077.05
存出保证金		4,443.88	9,787.41
交易性金融资产	6.4.7.2	41,401,483.99	42,929,996.15
其中：股票投资		41,401,483.99	42,929,996.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
资产总计		44,505,067.49	44,374,570.08
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		18,208.68	18,931.93
应付托管费		3,641.74	3,786.40
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.5	187,228.65	176,270.51
负债合计		209,079.07	198,988.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	38,443,862.00	38,443,862.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	5,852,126.42	5,731,719.24
净资产合计		44,295,988.42	44,175,581.24
负债和净资产总计		44,505,067.49	44,374,570.08

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额净值1.1522元，基金份额总额38,443,862.00份。

6.2 利润表

会计主体：山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		213,065.19	936,592.96
1.利息收入		3,488.66	6,096.06
其中：存款利息收入	6.4.7.8	3,488.66	6,096.06
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		991,699.28	89,326.17
其中：股票投资收益	6.4.7.9	128,102.60	-649,318.17
基金投资收益	6.4.7.10	-	-

债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	863,596.68	738,644.34
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	-774,170.72	628,633.09
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	-7,952.03	212,537.64
减：二、营业总支出		236,566.47	162,969.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	111,659.75	103,558.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	22,332.00	20,711.70
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	102,574.72	38,699.47
三、利润总额(亏损总额 以“-”号填列)		-23,501.28	773,623.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		-23,501.28	773,623.20

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-23,501.28	773,623.20

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023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）	38,443,862.00	-	5,731,719.24	44,175,581.24
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）	38,443,862.00	-	5,731,719.24	44,175,581.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	120,407.18	120,407.18
（一）、综合收益总额	-	-	-23,501.28	-23,501.28
（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）	-	-	143,908.46	143,908.46

其中：1.基金申购款	15,000,000.00	-	2,970,944.76	17,970,944.76
2.基金赎回款	-15,000,000.00	-	-2,827,036.30	-17,827,036.30
(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)	38,443,862.00	-	5,852,126.42	44,295,988.42
项目	上年度可比期间 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)	36,443,862.00	-	8,239,888.64	44,683,750.64
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)	36,443,862.00	-	8,239,888.64	44,683,750.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,000,000.00	-	928,960.73	3,928,960.73

(一)、综合收益总额	-	-	773,623.20	773,623.20
(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)	3,000,000.00	-	155,337.53	3,155,337.53
其中: 1.基金申购款	31,000,000.00	-	5,757,022.38	36,757,022.38
2.基金赎回款	-28,000,000.00	-	-5,601,684.85	-33,601,684.85
(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)	39,443,862.00	-	9,168,849.37	48,612,711.37

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:

王怡里

汤建雄

张立德

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

山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1596号《关于准予山西

证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准募集，由山西证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》发起，并于2020年1月17日募集成立。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次发售募集的有效认购资金人民币264,440,071.00元，折合264,440,071.00份基金份额；孳生利息人民币3,791.00元，折合3,791.00份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币264,443,862.00元，折合264,443,862.00份基金份额。其中，网上现金认购有效认购资金人民币251,352,000.00元，折合251,352,000.00份基金份额；网下现金认购有效认购资金人民币11,000,000.00元，折合11,000,000.00份基金份额，孳生利息3,791.00元，折合3,791.00份基金份额；网下股票认购折合有效认购资金人民币2,088,071.00元，折合2,088,071.00份基金份额。业经中喜会计师事务所（特殊普通合伙）中喜验字【2020】第00006号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为山西证券股份有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。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。

本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于基金非现金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构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：中证红利潜力指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表以持续经营为基础编制。

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")进行编制。同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定,并按照《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2023年06月30日的财务状况以及2023年01月01日至2023年06月30日止期间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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表相一致。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]70号《关于金融金构同业往来等增值税

补充政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税；2018年1月1日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税。

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

(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。对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在1个月以内(含1个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在1个月以上至1年(含1年)的, 暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。

对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.10%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

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 2023年06月30日
活期存款	3,052,680.69
等于：本金	3,052,397.42
加：应计利息	283.27
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	3,052,680.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	43,429,563.30	-	41,401,483.99	-2,028,079.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	43,429,563.30	-	41,401,483.99	-2,028,079.31

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06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	-
应付交易费用	14,994.36
其中：交易所市场	14,994.36
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	24,795.19
预提费用-审计费	7,439.10
应付指数使用费	140,000.00
合计	187,228.65

6.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	38,443,862.00	38,443,862.00
本期申购	15,000,000.00	15,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-15,000,000.00	-15,000,000.00
本期末	38,443,862.00	38,443,862.00

注：1、申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

6.4.7.7 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	18,908,372.25	-13,176,653.01	5,731,719.24
本期利润	750,669.44	-774,170.72	-23,501.28
本期基金份额交易产生的变动数	-7,702.65	151,611.11	143,908.46
其中：基金申购款	7,429,655.41	-4,458,710.65	2,970,944.76
基金赎回款	-7,437,358.06	4,610,321.76	-2,827,036.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,651,339.04	-13,799,212.62	5,852,126.42

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	3,100.85
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	336.72
其他	51.09
合计	3,488.66

6.4.7.9 股票投资收益

6.4.7.9.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	43,060.22
股票投资收益——赎回差价收入	85,042.38
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	128,102.60

6.4.7.9.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	8,750,634.00
减：卖出股票成本总额	8,682,231.02
减：交易费用	25,342.76
买卖股票差价收入	43,060.22

6.4.7.9.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
赎回基金份额对价总额	17,827,036.30
减：现金支付赎回款总额	4,141,878.30
减：赎回股票成本总额	13,600,115.62
减：交易费用	-
赎回差价收入	85,042.38

6.4.7.10 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

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**

本基金本报告期末无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券买卖差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	863,596.68
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	863,596.68

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	-774,170.72
——股票投资	-774,170.72
——债券投资	-
——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	-774,170.72

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	-7,952.03
合计	-7,952.03

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	7,439.10
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
汇划手续费	340.43
其他费用_指数使用费	70,000.00
合计	102,574.72

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

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

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
山西证券股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人
山西证券-光大银行-山证汇通启睿106号集合资产管理计划	基金管理人管理的产品
山西证券-光大银行-山证汇通启睿105号集合资产管理计划	基金管理人管理的产品
山西证券-邮储银行-山证汇通启睿103号集合资产管理计划	基金管理人管理的产品
山西证券-兴业银行-山证汇通启睿101号集合资产管理计划	基金管理人管理的产品
山西证券-邮储银行-山证汇通启睿102号集合资产管理计划	基金管理人管理的产品

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

所述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期股票成	成交金额	占当期股票成

		交总额的 比例		交总额的 比例
山西证券 股份有限 公司	20,296,128.20	100.00%	37,087,633.18	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
山西证券 股份有限 公司	14,994.36	100.00%	14,994.36	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
山西证券 股份有限	27,594.34	100.00%	27,594.34	100.00%

公司				
----	--	--	--	--

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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	111,659.75	103,558.59
其中：支付销售机构的客户维护费	37,490.24	34,911.02

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	22,332.00	20,711.70

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

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

本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行过债券（含回购）交易。

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**

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
基金合同生效日（2020年01月17日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	600,000.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	600,000.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

基金管理人投资本基金的费率按本基金合同公布的费率执行。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
山西证券-光大银行-山证汇通启睿106号集合资	420,000.00	1.09%	420,000.00	1.09%

产管理计划				
山西证券-光大银行-山证汇通启睿105号集合资产管理计划	1,310,000.00	3.41%	1,310,000.00	3.41%
山西证券-邮储银行-山证汇通启睿103号集合资产管理计划	1,180,000.00	3.07%	1,180,000.00	3.07%
山西证券-兴业银行-山证汇通启睿101号集合资产管理计划	1,549,000.00	4.03%	1,549,000.00	4.03%
山西证券-邮储银行-山证汇通启睿102号集合资产管理计划	700,000.00	1.82%	700,000.00	1.82%

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	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2023年01月01日至2023年06月30日		2022年01月01日至2022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
中国银行 股份有限 公司	3,052,680.69	3,100.85	3,723,066.71	5,378.76

本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

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

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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2023年06月30日止，本基金无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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年06月30日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

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

本基金为被动式指数基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金管理人的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会

负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。

（2）风险管理执行委员会

根据公司总体风险控制目标，将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门；讨论、协调各部门之间的风险管理过程；听取各部门风险管理工作方面的汇报，确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点，并调整与改进相关的风险处理和策略；讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告。

（3）投资决策委员会

负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略。

（4）公募基金管理业务专项合规负责人

按照规定履行公募基金管理业务合规负责人职责，对董事会负责。监督检查基金投资的合法合规性、基金运营的安全性对发现的问题，及时告知相关业务负责人，提出处理意见和整改建议，并监督整改措施的制定和落实。

（5）合规管理部：负责对公募基金管理业务相关制度、合同和流程进行合规性审核；按照监管机构的要求和公司的规定定期、不定期地进行合规检查，组织落实公募基金管理业务的业务隔离和反洗钱工作；负责处理公募基金管理业务相关法律诉讼事务。

（6）风险管理部：负责对整体业务进行全程监控，拟定和完善公募基金管理业务风险管理制度和风险控制流程；建立和完善公募基金管理业务风险监控指标体系；监控和检查公募基金管理业务运行情况；分析、评估公募基金管理业务的风险状况，并向公司总经理办公会及相关部门提交风险评估报告。

（7）稽核审计部：负责对公募基金管理业务进行全面的审计与监察、稽核，检查各部门对公募基金管理业务相关制度的执行情况，并出具监察稽核报告。

（8）业务部门

风险管理是每一个业务部门最首要的责任。各部门的部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

公募基金管理业务风险控制目标是通过建立科学的风险防范体系、风险控制机制及风险监测平台，及时发现、评估、规避、处理公募基金管理业务运作中的各类风险，确保公募基金管理业务合规开展，风险可测、可控、可承受。在风险识别、风险评估、风险测量等的基础上，及时对各种风险进行监督、检查和评估，对风险进行管理控制，制定风险控制决策，采取适当有效的风险控制措施，将风险控制在预期可承受的范围内，实现风险管理目标。

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。

本基金的基金管理人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，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均通过对交易对手的信用状况进行评估以控制相应的信用风险。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券暂时不能自由转让的情况外，本期末本基金的其他资产均能以合理价格及时变现。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资产的公允价值。

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》（自2017年10月1日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过风险管理体系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等流动性指标进行持续的监测和分析。

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。

基金管理人严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制进行投资管理，使基金组合资产的流动性安排与基金申赎安排相匹配，报告期内未发生流动性风险事件。

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。

本基金主要投资于证券交易所上市股票、交易所及银行间市场交易的固定收益品种、政府债券，利率变动影响市场投资者的风险偏好，同时也对企业未来现金流的净现值产生影响，进而对证券价格产生影响。

本基金的基金管理人实时对利率变动、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、投资风格等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,052,680.69	-	-	-	-	-	3,052,680.69
结算备付金	46,458.93	-	-	-	-	-	46,458.93
存出保证金	4,443.88	-	-	-	-	-	4,443.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-	41,401,483.99	41,401,483.99
资产总计	3,103,583.50	-	-	-	-	41,401,483.99	44,505,067.49
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	18,208.68	18,208.68
应付托管费	-	-	-	-	-	3,641.74	3,641.74
其他负债	-	-	-	-	-	187,228.65	187,228.65
负债总计	-	-	-	-	-	209,079.07	209,079.07
利率敏感度缺口	3,103,583.50	-	-	-	-	41,192,404.92	44,295,988.42
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,351,709.47	-	-	-	-	-	1,351,709.47
结算备付金	83,077.05	-	-	-	-	-	83,077.05
存出保	9,787.41	-	-	-	-	-	9,787.41

证金							
交易性金融资产	-	-	-	-	-	42,929,996.15	42,929,996.15
资产总计	1,444,573.93	-	-	-	-	42,929,996.15	44,374,570.08
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	18,931.93	18,931.93
应付托管费	-	-	-	-	-	3,786.40	3,786.40
其他负债	-	-	-	-	-	176,270.51	176,270.51
负债总计	-	-	-	-	-	198,988.84	198,988.84
利率敏感度缺口	1,444,573.93	-	-	-	-	42,731,007.31	44,175,581.24

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

本基金本报告期末无债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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股票，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。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金将以全部或接近全部的基金资产，按照标的指数的权重比例分散投资于各成份股。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于基金非现金资产的80%。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	41,401,483.99	93.47	42,929,996.15	97.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	41,401,483.99	93.47	42,929,996.15	97.18

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注7.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位： 人民币元)	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,036,264.68	2,023,057.97
	业绩比较基准下降5%	-2,036,264.68	-2,023,057.97

注：本基金的业绩比较基准为：中证红利潜力指数收益率。

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	41,401,483.99	42,929,996.15
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	41,401,483.99	42,929,996.15

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券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2023年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

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	41,401,483.99	93.03
	其中：股票	41,401,483.99	93.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,099,139.62	6.96
8	其他各项资产	4,443.88	0.01
9	合计	44,505,067.49	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（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,227,012.00	11.80
C	制造业	25,336,445.29	57.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	216,936.00	0.49
G	交通运输、仓储和邮政	-	-

	业		
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	488,429.00	1.10
J	金融业	7,450,068.00	16.82
K	房地产业	2,294,117.00	5.18
L	租赁和商务服务业	388,476.70	0.88
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	41,401,483.99	93.47

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资股票。

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	127,600	5,920,640.00	13.37

2	000651	格力电器	134,100	4,895,991.00	11.05
3	600519	贵州茅台	2,500	4,227,500.00	9.54
4	601088	中国神华	95,800	2,945,850.00	6.65
5	000333	美的集团	44,100	2,598,372.00	5.87
6	000858	五粮液	10,900	1,782,913.00	4.02
7	601225	陕西煤业	95,800	1,742,602.00	3.93
8	000002	万科A	119,300	1,672,586.00	3.78
9	600309	万华化学	17,823	1,565,572.32	3.53
10	600887	伊利股份	52,100	1,475,472.00	3.33
11	601601	中国太保	47,400	1,231,452.00	2.78
12	002415	海康威视	37,000	1,225,070.00	2.77
13	600585	海螺水泥	51,200	1,215,488.00	2.74
14	000568	泸州老窖	3,700	775,409.00	1.75
15	001979	招商蛇口	47,700	621,531.00	1.40
16	000895	双汇发展	24,800	607,352.00	1.37
17	600188	兖矿能源	18,000	538,560.00	1.22
18	300760	迈瑞医疗	1,700	509,660.00	1.15
19	600660	福耀玻璃	13,300	476,805.00	1.08
20	002304	洋河股份	3,400	446,590.00	1.01
21	603444	吉比特	900	441,999.00	1.00
22	600346	恒力石化	30,700	439,931.00	0.99
23	600741	华域汽车	17,400	321,204.00	0.73
24	300033	同花顺	1,700	297,976.00	0.67
25	601888	中国中免	2,500	276,325.00	0.62
26	000596	古井贡酒	1,000	247,380.00	0.56
27	600729	重庆百货	6,900	216,936.00	0.49
28	000581	威孚高科	13,600	214,200.00	0.48
29	603288	海天味业	4,445	208,248.25	0.47
30	000538	云南白药	3,880	203,622.40	0.46
31	600809	山西汾酒	1,000	185,070.00	0.42
32	688036	传音控股	1,100	161,700.00	0.37

33	603589	口子窖	3,100	152,985.00	0.35
34	002867	周大生	7,350	130,683.00	0.30
35	600295	鄂尔多斯	14,420	129,347.40	0.29
36	603195	公牛集团	1,332	127,951.92	0.29
37	600563	法拉电子	900	123,570.00	0.28
38	600389	江山股份	4,930	117,087.50	0.26
39	605168	三人行	1,305	112,151.70	0.25
40	600801	华新水泥	9,000	111,150.00	0.25
41	002032	苏泊尔	2,000	100,000.00	0.23
42	603489	八方股份	1,400	98,168.00	0.22
43	600612	老凤祥	1,300	90,844.00	0.21
44	002841	视源股份	1,300	86,892.00	0.20
45	300628	亿联网络	2,450	85,921.50	0.19
46	000789	万年青	10,100	78,275.00	0.18
47	000672	上峰水泥	6,800	62,084.00	0.14
48	002605	姚记科技	1,000	46,430.00	0.10
49	603877	太平鸟	1,200	30,336.00	0.07
50	688399	硕世生物	500	27,600.00	0.06

7.3.2 期末积极投资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

本基金本报告期末无积极投资股票。

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	000651	格力电器	1,826,481.00	4.13
2	000333	美的集团	970,694.00	2.20
3	000858	五粮液	844,158.00	1.91
4	000002	万科A	800,585.00	1.81
5	600519	贵州茅台	696,648.00	1.58

6	601318	中国平安	689,449.04	1.56
7	002415	海康威视	556,607.00	1.26
8	300760	迈瑞医疗	470,081.00	1.06
9	000596	古井贡酒	425,395.00	0.96
10	000568	泸州老窖	348,198.00	0.79
11	601088	中国神华	325,444.00	0.74
12	601225	陕西煤业	270,133.00	0.61
13	002304	洋河股份	242,719.00	0.55
14	001979	招商蛇口	230,974.00	0.52
15	000895	双汇发展	230,469.00	0.52
16	300033	同花顺	211,353.00	0.48
17	600309	万华化学	191,795.00	0.43
18	600887	伊利股份	175,005.00	0.40
19	600585	海螺水泥	161,784.00	0.37
20	603444	吉比特	154,946.00	0.35

本项"买入金额"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。

7.4.2 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	000651	格力电器	1,701,727.00	3.85
2	000333	美的集团	1,027,296.00	2.33
3	000858	五粮液	903,017.00	2.04
4	000002	万科A	747,307.00	1.69
5	002415	海康威视	590,821.00	1.34
6	300760	迈瑞医疗	504,634.00	1.14
7	000596	古井贡酒	418,852.00	0.95
8	000568	泸州老窖	373,616.00	0.85
9	002304	洋河股份	259,473.00	0.59

10	300033	同花顺	215,590.00	0.49
11	001979	招商蛇口	214,561.00	0.49
12	000895	双汇发展	213,973.00	0.48
13	601318	中国平安	197,062.00	0.45
14	600519	贵州茅台	172,115.00	0.39
15	000581	威孚高科	120,094.00	0.27
16	002841	视源股份	103,865.00	0.24
17	300628	亿联网络	100,957.00	0.23
18	601088	中国神华	87,976.00	0.20
19	002032	苏泊尔	85,376.00	0.19
20	000538	云南白药	83,768.00	0.19

本项"卖出金额"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。

7.4.3 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	11,545,494.20
卖出股票收入（成交）总额	8,750,634.00

本项"买入股票的成本（成交）总额"和"卖出股票的收入（成交）总额"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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关政策。

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**

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关政策。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	4,443.88
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	4,443.88

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无积极投资股票。

§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

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
459	83,755.69	19,190,655.00	49.92%	19,253,207.00	50.08%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	朔州市资产管理有限公司	10,000,000.00	26.01%
2	陶雪华	6,704,900.00	17.44%
3	中信建投证券股份有限公司	4,031,655.00	10.49%
4	谭丽萍	1,833,700.00	4.77%
5	山西证券—兴业银行—山证汇通启睿101号集合资产管理计划	1,549,000.00	4.03%
6	山西证券—光大银行—山证汇通启睿105号集合资产管理计划	1,310,000.00	3.41%
7	山西证券—邮储银行—山证汇通启睿103号集合资产	1,180,000.00	3.07%

	管理计划		
8	吕雅俐	760,000.00	1.98%
9	山西证券—邮储银行—山证汇通启睿102号集合资产管理计划	700,000.00	1.82%
10	张爱华	500,000.00	1.30%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	258,900.00	0.6734%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年01月17日)基金份额总额	264,443,862.00
本报告期期初基金份额总额	38,443,862.00
本报告期基金总申购份额	15,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	15,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	38,443,862.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

(1) 基金管理人的重大人事变动

公司董事会于 2023 年 6 月 9 日收到高级管理人员王学斌先生的书面辞职申请。王学斌先生因个人原因，向公司董事会申请辞去公司执行委员会委员职务。辞职后，王学斌先生不在公司及控股子公司担任任何职务。

(2) 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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

(1) 本报告期内本基金管理人无重大诉讼、仲裁事项。

(2) 本报告期内无涉及本基金财产的诉讼。

(3) 本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金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

为本基金提供审计服务的会计师事务所为中喜会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金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	
山西	2	4,684,724.20	23.08%	3,443.36	22.96%	-

证券						
山西 证券	3	15,611,404.00	76.92%	11,551.00	77.04%	-

1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司。其中财务状况良好、经营行为规范以最近一年证券公司分类评介在C类或C类以上，且近一年内无重大违法违规事件为主要判断依据。研究实力较强以公司基金业务部投研团队的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

3、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能租赁其他证券公司的交易单元，只能使用本基金管理人自有的交易单元。

4、本基金本报告期内未新增交易单元。

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

本报告期本基金租用证券公司交易单元暂无进行其他证券投资的情况。

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	关于山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-28
2	关于山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-10
3	山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新（2023年第1号）	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-26

4	山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-26
5	关于山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-11
6	关于山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-29
7	山西证券股份有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-21
8	山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-21
9	关于山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-15
10	山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-28
11	关于山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-15
12	关于山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-08
13	关于山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资	中国证监会规定报刊及网站	2023-02-22

	基金基金资产净值低于5000万元的提示性公告		
14	山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金2022年第四季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-19
15	关于山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-17
16	关于山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-10

§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	20230101-20230630	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	26.01%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，由于持有人结构比较集中，资金易呈现“大进大出”特点。在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能造成基金净值的波动，甚至可能引发基金的流动性风险。							

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、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金合同；
- 3、山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金托管协议；
- 4、山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；

- 5、山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内本基金披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者可以通过以下途径咨询相关事宜：

- 1、客服热线：0351-95573
- 2、公司公募基金业务网站：<http://publiclyfund.sxzq.com>:8000

山西证券股份有限公司
二〇二三年八月二十九日