

同泰沪深 300 指数量化增强型证券  
投资基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：同泰基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
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 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
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 .....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
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	13
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 .....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	37

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 .....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	43
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 .....	43
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 ..	43
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 ..	43
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 .....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	44
7.12 投资组合报告附注 .....	44
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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的情况 .....	46
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>46</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>48</b>
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 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	同泰沪深 300 量化增强	
基金主代码	012911	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 7 月 23 日	
基金管理人	同泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	86,907,752.90 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	同泰沪深 300 量化增强 A	同泰沪深 300 量化增强 C
下属分级基金的交易代码	012911	012912
报告期末下属分级基金的份额总额	67,566,360.31 份	19,341,392.59 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金,在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上,结合量化投资方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越标的指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法进行投资组合优化,在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下,力争获得超越标的指数的投资收益。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%,年化跟踪误差不超过 8.0%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×90%+恒生综合指数收益率×5%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,长期平均风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金可投资港股通标的股票,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		同泰基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	滕大江	罗菲菲
	联系电话	0755-23537896	010-58560666
	电子邮箱	tengdj@tongtaiamc.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-830-1666	95568

传真	0755-23537801	010-57093382
注册地址	深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号深业上城(南区)T2 栋 41 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址	深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号深业上城(南区)T2 栋 41 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	518033	100031
法定代表人	马俊生	高迎欣

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.tongtaiamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	同泰基金管理有限公司	深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号深业上城(南区)T2 栋 41 层

## § 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

基金类别	同泰沪深 300 量化增强 A	同泰沪深 300 量化增强 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）	报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-3,719,677.38	-982,366.77
本期利润	-2,785,420.55	-759,326.19
加权平均基金份额本期利润	-0.0386	-0.0393
本期加权平均净值利润率	-4.81%	-4.94%
本期基金份额净值增长率	-5.37%	-5.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 6 月 30 日）	
期末可供分配利润	-16,736,515.45	-4,872,991.34
期末可供分配基金份额利润	-0.2477	-0.2519
期末基金资产净值	50,829,844.86	14,468,401.25
期末基金份额净值	0.7523	0.7481
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 6 月 30 日）	

基金份额累计净值增长率	-24.77%	-25.19%
-------------	---------	---------

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、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(为期末余额，不是当期发生数)。

3、以上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(例如基金申购赎回费、基金转换费等)，计入费用后实际利润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

同泰沪深 300 量化增强 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	-0.32%	0.83%	1.21%	0.84%	-1.53%	-0.01%
过去三个月	-6.72%	0.86%	-5.02%	0.79%	-1.70%	0.07%
过去六个月	-5.37%	0.88%	-0.87%	0.81%	-4.50%	0.07%
过去一年	-19.36%	0.97%	-13.54%	0.96%	-5.82%	0.01%
自基金合同生效起至今	-24.77%	1.11%	-24.55%	1.08%	-0.22%	0.03%

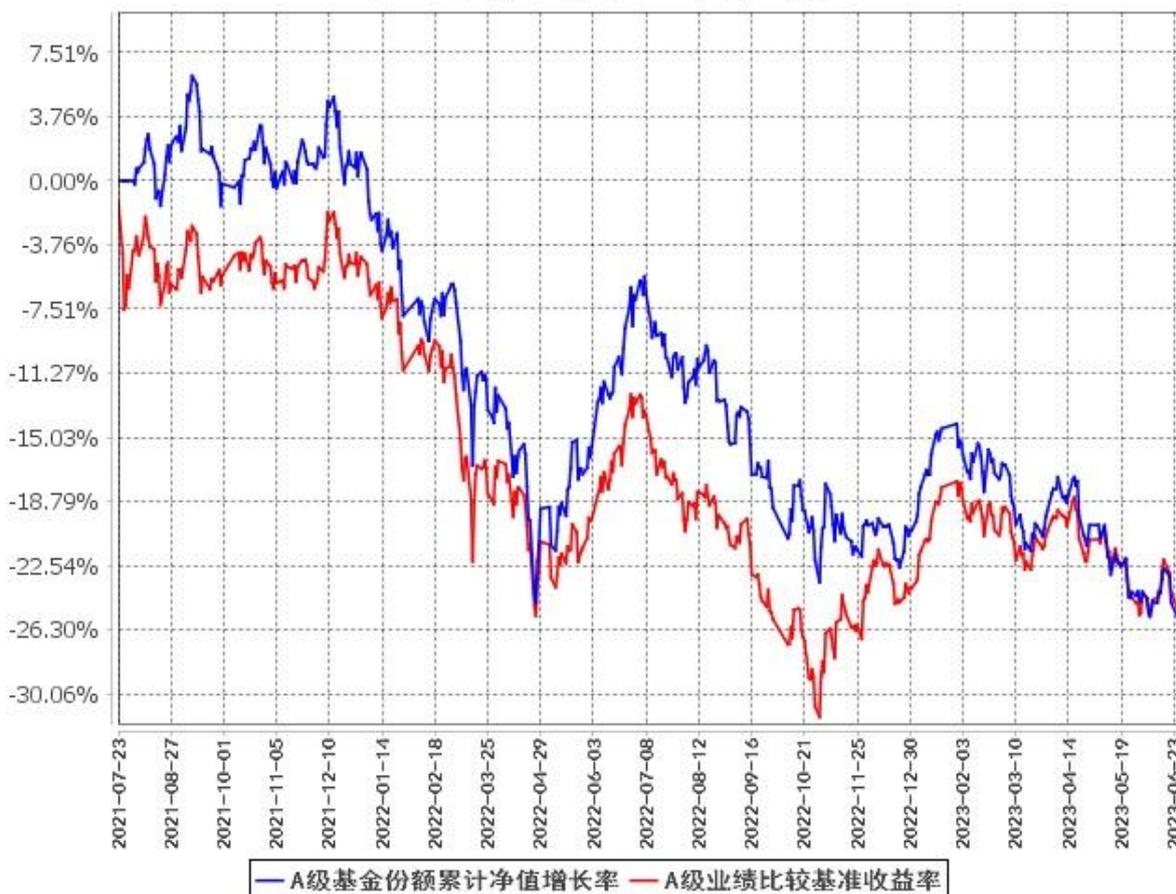
同泰沪深 300 量化增强 C

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	-0.35%	0.83%	1.21%	0.84%	-1.56%	-0.01%
过去三个月	-6.78%	0.86%	-5.02%	0.79%	-1.76%	0.07%
过去六个月	-5.51%	0.88%	-0.87%	0.81%	-4.64%	0.07%
过去一年	-19.59%	0.97%	-13.54%	0.96%	-6.05%	0.01%
自基金合同生效起至今	-25.19%	1.11%	-24.55%	1.08%	-0.64%	0.03%

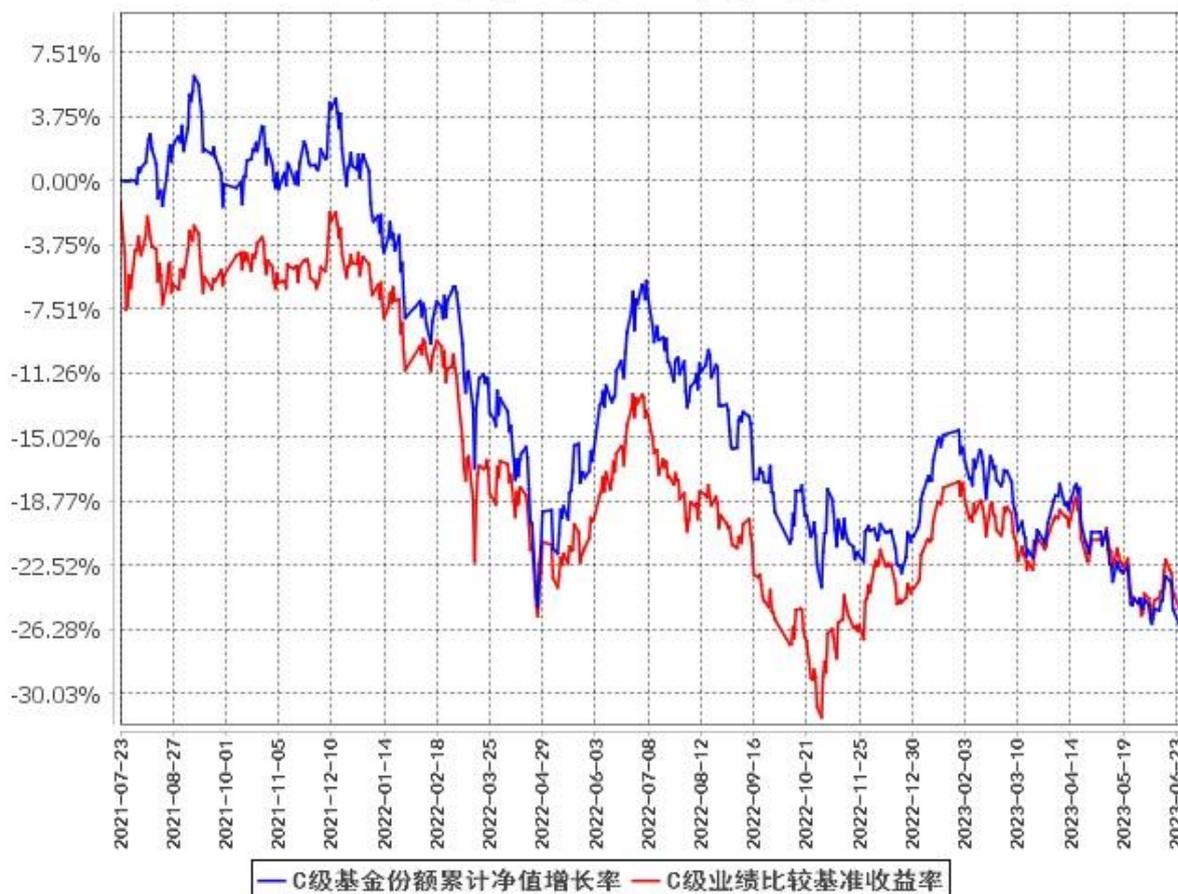
注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×90%+恒生综合指数收益率×5%+银行活期存款利率(税后)×5%，每日进行再平衡过程。

### 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

**A级基金份额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**  
(2021年7月23日至2023年6月30日)



**C级基金份额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**  
(2021年7月23日至2023年6月30日)



注：本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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

本基金基金管理人为同泰基金管理有限公司，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[2018]1497 号文批准设立，于 2018 年 10 月 11 日在深圳注册成立，注册资本 1 亿元人民币，并于 2019 年 3 月 15 日取得中国证监会核发的《经营证券期货业务许可证》。目前，公司股东及其出资比例为：刘文灿先生 33.3%，刘韞芬女士 32%，上海蓝尚投资管理中心(有限合伙)20%，马俊生先生 4.9%，王雪梅女士 4.9%，王敏飞先生 4.9%。截止本报告期末，本基金管理人

共管理了 22 只开放式基金。

#### 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		
杨喆	本基金 基金经 理,投 资研究 部总监	2021 年 7 月 23 日	-	21	杨喆先生，中国国籍，硕士。曾任国富投资管理有限公司研究员、瑞泰人寿股份有限公司投资经理、中信证券股份有限公司研究员、策略组负责人、投资主办人、银河金汇证券资产管理有限公司权益及量化投资部总经理、研究部总经理、投资主办人等职。2019 年 6 月加入同泰基金管理有限公司，现任投资研究部总监、同泰开泰混合型证券投资基金基金经理、同泰慧盈混合型证券投资基金基金经理、同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金基金经理、同泰金融精选股票型证券投资基金基金经理、同泰产业升级混合型证券投资基金基金经理。

1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

2、基金的非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，无此情况。

#### 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，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，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

风险的前提下，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。

### 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，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，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投资组合。报告期内，本基金管理人对连续 4 个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5%的情况，且未发现其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 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

2023 年上半年国内宏观经济在复苏阶段，但资本市场的心态经历了从年初是快速复苏的强预期到二季度弱现实的转变；政策保持了定力，适度刺激为主。美国经济和就业数据较强，升息持续度超过预期，目前接近尾声。人民币在二季度贬值压力加大，国内贵金属和债市偏强。

A 股市场上半年有两条主线：数字经济与 AI、中国特色估值。两条主线崛起于一季度，分化在二季度，数字经济与 AI 反复强化和泛化，中特估板块一波之后处于平静期。

本基金保持成立以来的指数量化增强策略，组合运用量化方式对沪深 300 做适当增强，通过行业景气度判断、因子有效性定期计算实现组合的持续优化。

2023 年上半年市场分化、轮动快和节奏不持续，因子有效性表现不够连续，净值表现不够理想。部分行业的快速上涨和单峰式见顶回调，也对因子模型的发挥产生了困扰。我们在组合管理中对于市场偏弱、非业绩和估值导向、主题化轮动所做的应对不够，还有需要补足的地方。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末同泰沪深 300 量化增强 A 的基金份额净值为 0.7523 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.37%；截至本报告期末同泰沪深 300 量化增强 C 的基金份额净值为 0.7481 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.51%；同期业绩比较基准收益率为-0.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济继续复苏，更多地自我寻求结构突破，辅以政策推动、资本市场助力，会是相当长一段时间的状态。我们对下半年的宏观政策力度保持偏乐观预期，在拉动地产和汽车消费、保障就业、扶持优质产业、化解债务风险等方面都会有积极动作。

A 股经过一年多的调整目前估值不高，海量居民理财资产逐步通过银行理财产品、公募基金、专户、FOF 产品等逐步进入市场是个长期过程。国内经济足够有韧性、目前在复苏阶段，权益市场估值低位，可以获得业绩增长和估值提升的两部分收益。

7 月重要会议也提到了活跃资本市场，我们相信是个会真实发生的慢热过程，进入成交量提高、有赚钱效应的正循环。景气度投资、自下而上的深度发掘、短期共识度高的主题化投资，都会有表现的机会。

本组合将用量化方式继续做沪深 300 增强配置，根据因子有效性不断调整组合，期待在经济回升途中本组合能分享到 300 指数的收益，也能分享到经济结构不断优化和高质量发展的过程中优质企业的阿尔法收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括估值委员会、运营部及相关部门。

本基金的日常估值程序通常由运营部估值核算岗执行并由业务复核岗复核估值结果，最终由估值核算岗与基金托管人的估值结果核对一致。

本基金的特别估值程序由估值委员会秘书部门运营部在收到启动特殊估值程序的请求后，通过估值核算人员及时与基金托管人沟通协商，必要时征求会计师事务所的专业意见，并将有关信息及材料一并报送全体估值委员会成员；估值委员会应综合考虑投资研究部和运营部等各方面的意见和建议，并按照有关议事规则讨论审议，决定批准或不批准使用特殊估值调整；运营部应当根据经估值委员会审议通过的特别估值调整意见执行估值程序，准备特殊估值调整事项的临时公告，并发起信息披露审批流程；监察稽核部应当对特殊估值调整事项的相关信息披露进行合规审核。

截止报告期末，本基金管理人已与中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 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：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基

金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类别的每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

本基金本报告期内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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关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约定进行。

### 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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、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：同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	187,136.52	1,356,023.26

结算备付金		68,756.15	68,756.15
存出保证金		5,664,866.76	4,813,368.05
交易性金融资产	6.4.7.2	59,590,467.42	71,126,572.19
其中：股票投资		59,590,467.42	71,126,572.19
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		30,408.73	3,010,552.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		65,541,635.58	80,375,272.13
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		105,142.43	35,684.73
应付管理人报酬		54,235.01	67,490.14
应付托管费		8,135.24	10,123.53
应付销售服务费		3,644.19	4,164.64
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	6.4.7.6	72,232.60	150,002.28
负债合计		243,389.47	267,465.32
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	86,907,752.90	100,851,738.15
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-21,609,506.79	-20,743,931.34
净资产合计		65,298,246.11	80,107,806.81
负债和净资产总计		65,541,635.58	80,375,272.13

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 86,907,752.90 份，其中同泰沪深 300 量化增强

A 基金份额净值 0.7523 元，基金份额总额 67,566,360.31 份；同泰沪深 300 量化增强 C 基金份额净值 0.7481 元，基金份额总额 19,341,392.59 份。

## 6.2 利润表

会计主体：同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-3,069,974.44	-8,438,788.93
1. 利息收入		11,237.50	12,001.20
其中：存款利息收入	6.4.7.9	11,237.50	12,001.20
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）		-4,250,913.41	-11,900,927.83
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,685,219.40	-12,371,438.90
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	5,664.16
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	434,305.99	464,846.91
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）	6.4.7.17	1,157,297.41	3,444,228.16
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. 18	12, 404. 06	5, 909. 54
<b>减：二、营业总支出</b>		474, 772. 30	605, 475. 64
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	364, 055. 12	444, 936. 15
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	54, 608. 23	66, 740. 48
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	22, 887. 37	18, 545. 80
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	6. 4. 7. 19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 20	33, 221. 58	75, 253. 21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-3, 544, 746. 74	-9, 044, 264. 57
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-3, 544, 746. 74	-9, 044, 264. 57
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-3, 544, 746. 74	-9, 044, 264. 57

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	100, 851, 738. 15	-	-20, 743, 931. 34	80, 107, 806. 81
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）	100, 851, 738. 15	-	-20, 743, 931. 34	80, 107, 806. 81

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-13,943,985.25	-	-865,575.45	-14,809,560.70
（一）、综合收益总额	-	-	-3,544,746.74	-3,544,746.74
（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）	-13,943,985.25	-	2,679,171.29	-11,264,813.96
其中：1. 基金申购款	17,156,015.44	-	-3,304,440.97	13,851,574.47
2. 基金赎回款	-31,100,000.69	-	5,983,612.26	-25,116,388.43
（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）	86,907,752.90	-	-21,609,506.79	65,298,246.11
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	102,459,055.87	-	1,667,201.73	104,126,257.60
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）	102,459,055.87	-	1,667,201.73	104,126,257.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,848,131.35	-	-8,184,896.31	-14,033,027.66
（一）、综合收益总额	-	-	-9,044,264.57	-9,044,264.57

(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)	-5,848,131.35	-	859,368.26	-4,988,763.09
其中: 1. 基金申购款	17,713,919.60	-	-1,847,602.06	15,866,317.54
2. 基金赎回款	-23,562,050.95	-	2,706,970.32	-20,855,080.63
(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)	96,610,924.52	-	-6,517,694.58	90,093,229.94

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:

马俊生	杨伍	刘韞芬
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

同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金(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[2021]2119号《关于准予同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人同泰基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于 2021 年 7 月 23 日正式生效,首次设立募集规模为 201,621,304.59 份基金份额。

本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为同泰基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及备选成份股、非标的指数成份股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证及港股通标的股票)、债券(包括国家债券、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、金融债券、企业债券、

公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 80%-95%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 20%，每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约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。股指期货、国债期货、股票期权的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×90%+恒生综合指数收益率×5%+银行活期存款利率(税后)×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

## 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〔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〔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〕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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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2018年1月1日起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。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，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。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%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。

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

## 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 6 月 30 日
活期存款	187,136.52
等于：本金	187,112.52
加：应计利息	24.00
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	187,136.52

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	63,440,383.97	-	59,590,467.42	-3,849,916.55
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	63,440,383.97	-	59,590,467.42	-3,849,916.55

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.12
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	72,232.48

合计	72,232.60
----	-----------

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

同泰沪深 300 量化增强 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	78,962,286.83	78,962,286.83
本期申购	6,859,820.13	6,859,820.13
本期赎回（以“-”号填列）	-18,255,746.65	-18,255,746.65
本期末	67,566,360.31	67,566,360.31

金额单位：人民币元

同泰沪深 300 量化增强 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,889,451.32	21,889,451.32
本期申购	10,296,195.31	10,296,195.31
本期赎回（以“-”号填列）	-12,844,254.04	-12,844,254.04
本期末	19,341,392.59	19,341,392.59

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

同泰沪深 300 量化增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-11,750,804.24	-4,434,221.75	-16,185,025.99
本期利润	-3,719,677.38	934,256.83	-2,785,420.55
本期基金份额交易产生的变动数	1,989,599.72	244,331.37	2,233,931.09
其中：基金申购款	-1,196,239.99	-54,826.07	-1,251,066.06
基金赎回款	3,185,839.71	299,157.44	3,484,997.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,480,881.90	-3,255,633.55	-16,736,515.45

单位：人民币元

同泰沪深 300 量化增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,330,797.71	-1,228,107.64	-4,558,905.35

本期利润	-982,366.77	223,040.58	-759,326.19
本期基金份额交易产生的变动数	370,872.30	74,367.90	445,240.20
其中：基金申购款	-1,862,726.04	-190,648.87	-2,053,374.91
基金赎回款	2,233,598.34	265,016.77	2,498,615.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,942,292.18	-930,699.16	-4,872,991.34

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	998.57
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	-
其他	10,238.93
合计	11,237.50

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,685,219.40
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	-4,685,219.40

##### 6.4.7.10.2 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 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	83,473,956.94

减：卖出股票成本总额	87,948,312.28
减：交易费用	210,864.06
买卖股票差价收入	-4,685,219.40

#### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

## 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	434,305.99
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	434,305.99

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,157,297.41
——股票投资	1,157,297.41
——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	1,157,297.41

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	12,404.05
基金转出费	0.01
合计	12,404.06

#### 6.4.7.19 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	12,396.69
信息披露费	19,835.79
证券出借违约金	-
银行费用	989.10
合计	33,221.58

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大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

本报告期内本基金管理人新增王敏飞为公司股东。

##### 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
同泰基金管理有限公司	管理人、销售机构、注册登记机构
中国民生银行股份有限公司	托管人

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 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 基金交易

无。

###### 6.4.10.1.5 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.6 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 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	364,055.12	444,936.15
其中：支付销售机构的客户维护费	174,797.11	210,828.70

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	54,608.23	66,740.48

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	同泰沪深 300 量化增强 A	同泰沪深 300 量化增强 C	合计
同泰基金管理有限公司	-	0.62	0.62
合计	-	0.62	0.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	同泰沪深 300 量化增强 A	同泰沪深 300 量化增强 C	合计
同泰基金管理有限公司	-	4.25	4.25

合计	-	4.25	4.25
----	---	------	------

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 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 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

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

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

份额单位：份

同泰沪深 300 量化增强 A				
关联方名称	本期末 2023 年 6 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
自然人股东	197.63	0.00%	197.63	0.00%

份额单位：份

同泰沪深 300 量化增强 C				
关联方名称	本期末 2023 年 6 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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比

		例		例
自然人股东	400.07	0.00%	400.07	0.00%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	187,136.52	998.57	275,404.20	3,973.19

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 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

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理架构由董事会下的风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、监察稽核部、以及各个业务部门组成。

##### 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经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本公司管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金未持有债券。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期不适用。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期不适用。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期不适用。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期不适用。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期不适用。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期不适用。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

本基金的基金管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金本报告期不适用。

##### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制(如有)外，本基金所持的大部分证券均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理。

本报告期内，未发生重大流动性风险事件。

#### 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	187,136.52	-	-	-	187,136.52
结算备付金	68,756.15	-	-	-	68,756.15
存出保证金	5,664,866.76	-	-	-	5,664,866.76
交易性金融资产	-	-	-	59,590,467.42	59,590,467.42
应收申购款	-	-	-	30,408.73	30,408.73
资产总计	5,920,759.43	-	-	59,620,876.15	65,541,635.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	105,142.43	105,142.43
应付管理人报酬	-	-	-	54,235.01	54,235.01
应付托管费	-	-	-	8,135.24	8,135.24
应付销售服务费	-	-	-	3,644.19	3,644.19
其他负债	-	-	-	72,232.60	72,232.60
负债总计	-	-	-	243,389.47	243,389.47
利率敏感度缺口	5,920,759.43	-	-	59,377,486.68	65,298,246.11
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,356,023.26	-	-	-	1,356,023.26
结算备付金	68,756.15	-	-	-	68,756.15
存出保证金	4,813,368.05	-	-	-	4,813,368.05
交易性金融资产	-	-	-	71,126,572.19	71,126,572.19
应收申购款	-	-	-	3,010,552.48	3,010,552.48
资产总计	6,238,147.46	-	-	74,137,124.67	80,375,272.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	35,684.73	35,684.73
应付管理人报酬	-	-	-	67,490.14	67,490.14

应付托管费	-	-	-	10,123.53	10,123.53
应付销售服务费	-	-	-	4,164.64	4,164.64
其他负债	-	-	-	150,002.28	150,002.28
负债总计	-	-	-	267,465.32	267,465.32
利率敏感度缺口	6,238,147.46	-	-	73,869,659.35	80,107,806.81

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有债券或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对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，无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

本基金本报告期不适用。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期不适用。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

##### 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6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	59,590,467.42	91.26	71,126,572.19	88.79
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	59,590,467.42	91.26	71,126,572.19	88.79

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数收益率以外的其他市场价格变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数收益率上升 5%	2,832,578.87	3,607,475.04
	沪深 300 指数收益率下降 5%	-2,832,578.87	-3,607,475.04

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金本报告期不适用。

#### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	59,590,467.42	71,126,572.19
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	59,590,467.42	71,126,572.19

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易

不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 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	59,590,467.42	90.92
	其中：股票	59,590,467.42	90.92
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	255,892.67	0.39
8	其他各项资产	5,695,275.49	8.69
9	合计	65,541,635.58	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	867,554.00	1.33
C	制造业	27,048,452.40	41.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,192,506.00	3.36
E	建筑业	3,629,659.96	5.56
F	批发和零售业	433,700.00	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	332,320.00	0.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	255,690.00	0.39
J	金融业	11,657,450.25	17.85
K	房地产业	30,844.00	0.05
L	租赁和商务服务业	176,848.00	0.27
M	科学研究和技术服务业	1,173,270.00	1.80
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	47,798,294.61	73.20

## 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

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	24,557.55	0.04
C	制造业	9,728,274.00	14.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,011,652.56	1.55
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	13,196.70	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	275,292.00	0.42
J	金融业	204,600.00	0.31
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	534,600.00	0.82

S	综合	-	-
	合计	11,792,172.81	18.06

### 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标的股票。

### 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	600926	杭州银行	210,000	2,467,500.00	3.78
2	601838	成都银行	181,965	2,221,792.65	3.40
3	600519	贵州茅台	1,100	1,860,100.00	2.85
4	601689	拓普集团	22,000	1,775,400.00	2.72
5	603806	福斯特	47,000	1,747,930.00	2.68
6	002459	晶澳科技	38,177	1,591,980.90	2.44
7	603986	兆易创新	13,000	1,381,250.00	2.12
8	688008	澜起科技	21,000	1,205,820.00	1.85
9	300274	阳光电源	10,000	1,166,300.00	1.79
10	600150	中国船舶	30,000	987,300.00	1.51
11	688223	晶科能源	70,000	984,200.00	1.51
12	300408	三环集团	33,000	968,550.00	1.48
13	600039	四川路桥	98,000	961,380.00	1.47
14	002594	比亚迪	3,700	955,599.00	1.46
15	601788	光大证券	60,000	953,400.00	1.46
16	601600	中国铝业	170,000	933,300.00	1.43
17	601117	中国化学	109,907	910,029.96	1.39
18	300896	爱美客	2,000	889,900.00	1.36
19	600011	华能国际	90,000	833,400.00	1.28
20	688599	天合光能	19,000	809,590.00	1.24
21	601009	南京银行	100,000	800,000.00	1.23
22	601618	中国中冶	200,000	794,000.00	1.22
23	601601	中国太保	30,000	779,400.00	1.19
24	601799	星宇股份	6,000	741,600.00	1.14
25	600919	江苏银行	100,000	735,000.00	1.13
26	600028	中国石化	105,400	670,344.00	1.03
27	000938	紫光股份	20,000	637,000.00	0.98
28	688065	凯赛生物	10,000	622,600.00	0.95
29	600309	万华化学	7,000	614,880.00	0.94

30	300759	康龙化成	16,000	612,480.00	0.94
31	002821	凯莱英	5,000	589,300.00	0.90
32	601901	方正证券	90,000	588,600.00	0.90
33	603259	药明康德	9,000	560,790.00	0.86
34	601877	正泰电器	20,000	553,000.00	0.85
35	601800	中国交建	50,000	545,500.00	0.84
36	002179	中航光电	11,830	536,490.50	0.82
37	600795	国电电力	140,000	536,200.00	0.82
38	601238	广汽集团	50,000	521,000.00	0.80
39	605499	东鹏饮料	3,000	518,700.00	0.79
40	603019	中科曙光	10,000	509,000.00	0.78
41	600031	三一重工	30,000	498,900.00	0.76
42	601628	中国人寿	14,000	489,440.00	0.75
43	300059	东方财富	32,808	465,873.60	0.71
44	600893	航发动力	11,000	464,860.00	0.71
45	600900	长江电力	20,100	443,406.00	0.68
46	601939	建设银行	70,000	438,200.00	0.67
47	000963	华东医药	10,000	433,700.00	0.66
48	000776	广发证券	29,200	429,532.00	0.66
49	601186	中国铁建	40,000	394,000.00	0.60
50	600886	国投电力	30,000	379,500.00	0.58
51	603369	今世缘	7,000	369,600.00	0.57
52	002475	立讯精密	10,000	324,500.00	0.50
53	000333	美的集团	5,200	306,384.00	0.47
54	603833	欧派家居	3,000	287,400.00	0.44
55	002271	东方雨虹	9,600	261,696.00	0.40
56	000977	浪潮信息	5,000	242,500.00	0.37
57	601377	兴业证券	39,100	239,292.00	0.37
58	601818	光大银行	70,000	214,900.00	0.33
59	000708	中信特钢	13,300	210,672.00	0.32
60	002230	科大讯飞	3,000	203,880.00	0.31
61	002236	大华股份	10,000	197,500.00	0.30
62	603993	洛阳钼业	37,000	197,210.00	0.30
63	601111	中国国航	23,000	189,520.00	0.29
64	601318	中国平安	4,000	185,600.00	0.28
65	002142	宁波银行	7,000	177,100.00	0.27
66	601888	中国中免	1,600	176,848.00	0.27
67	601328	交通银行	30,000	174,000.00	0.27
68	000858	五粮液	1,000	163,570.00	0.25
69	601398	工商银行	30,000	144,600.00	0.22
70	600276	恒瑞医药	3,000	143,700.00	0.22
71	600115	中国东航	30,000	142,800.00	0.22

72	600600	青岛啤酒	1,000	103,630.00	0.16
73	600030	中信证券	5,200	102,856.00	0.16
74	000063	中兴通讯	2,000	91,080.00	0.14
75	002050	三花智控	3,000	90,780.00	0.14
76	300957	贝泰妮	1,000	88,880.00	0.14
77	688561	奇安信	1,000	51,810.00	0.08
78	601211	国泰君安	3,600	50,364.00	0.08
79	600176	中国巨石	3,000	42,480.00	0.07
80	300450	先导智能	1,000	36,170.00	0.06
81	000002	万科 A	2,200	30,844.00	0.05
82	600606	绿地控股	9,000	24,750.00	0.04
83	000876	新希望	2,000	23,360.00	0.04

### 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

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	603197	保隆科技	19,000	1,030,750.00	1.58
2	600027	华电国际	150,000	1,003,500.00	1.54
3	603180	金牌厨柜	29,000	972,080.00	1.49
4	002865	钧达股份	6,000	915,180.00	1.40
5	002531	天顺风能	50,000	761,500.00	1.17
6	688680	海优新材	6,000	730,920.00	1.12
7	300260	新莱应材	16,200	640,224.00	0.98
8	002396	星网锐捷	24,000	542,160.00	0.83
9	002991	甘源食品	7,000	536,900.00	0.82
10	300364	中文在线	30,000	534,600.00	0.82
11	688041	海光信息	7,000	477,890.00	0.73
12	300604	长川科技	10,000	474,900.00	0.73
13	688063	派能科技	2,000	396,500.00	0.61
14	000807	云铝股份	30,000	381,900.00	0.58
15	300693	盛弘股份	10,000	369,200.00	0.57
16	300073	当升科技	7,000	352,310.00	0.54
17	301308	江波龙	3,000	305,280.00	0.47
18	300443	金雷股份	8,000	283,600.00	0.43
19	688153	唯捷创芯	3,000	219,480.00	0.34
20	601128	常熟银行	30,000	204,600.00	0.31
21	002439	启明星辰	6,700	199,392.00	0.31
22	600416	湘电股份	10,000	190,900.00	0.29
23	600487	亨通光电	10,000	146,600.00	0.22
24	002602	世纪华通	10,000	75,900.00	0.12

25	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.04
26	603162	海通发展	774	13,196.70	0.02
27	603291	联合水务	536	8,152.56	0.01

## 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	002821	凯莱英	1,848,240.00	2.31
2	603806	福斯特	1,693,778.80	2.11
3	601689	拓普集团	1,481,057.00	1.85
4	002459	晶澳科技	1,461,123.40	1.82
5	688008	澜起科技	1,326,648.49	1.66
6	002558	巨人网络	1,296,152.00	1.62
7	002032	苏泊尔	1,254,504.00	1.57
8	002236	大华股份	1,240,424.00	1.55
9	000603	盛达资源	1,215,172.00	1.52
10	601377	兴业证券	1,180,900.00	1.47
11	002129	TCL 中环	1,177,608.00	1.47
12	002230	科大讯飞	1,112,769.00	1.39
13	600845	宝信软件	1,101,358.00	1.37
14	300438	鹏辉能源	1,082,008.00	1.35
15	300059	东方财富	1,068,598.00	1.33
16	600309	万华化学	1,041,329.00	1.30
17	600027	华电国际	1,033,200.00	1.29
18	603197	保隆科技	989,602.00	1.24
19	688223	晶科能源	985,110.00	1.23
20	601009	南京银行	960,000.00	1.20

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额(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	600036	招商银行	3,171,448.00	3.96
2	002032	苏泊尔	1,630,177.00	2.03
3	002050	三花智控	1,591,355.00	1.99
4	002230	科大讯飞	1,545,758.00	1.93
5	600085	同仁堂	1,537,649.00	1.92

6	002555	三七互娱	1,470,296.00	1.84
7	300763	锦浪科技	1,449,242.00	1.81
8	000568	泸州老窖	1,421,593.00	1.77
9	600919	江苏银行	1,408,428.00	1.76
10	002518	科士达	1,379,074.00	1.72
11	300911	亿田智能	1,361,227.00	1.70
12	002129	TCL 中环	1,286,575.00	1.61
13	603369	今世缘	1,269,776.00	1.59
14	605117	德业股份	1,252,337.00	1.56
15	603180	金牌厨柜	1,228,140.00	1.53
16	600309	万华化学	1,192,185.00	1.49
17	000603	盛达资源	1,178,984.00	1.47
18	000858	五粮液	1,161,682.00	1.45
19	600845	宝信软件	1,154,379.00	1.44
20	601800	中国交建	1,135,937.00	1.42

注：本项的“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	75,254,910.10
卖出股票收入（成交）总额	83,473,956.94

注：本项的“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

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

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，届时将根据风险管理原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

## 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

在法律法规允许的范围内，本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，投资于国债期货合约，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	5,664,866.76
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,408.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,695,275.49

注：本基金持有的存出保证金包含存放在证券经纪商资金账户的证券交易结算资金。

#### 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

本基金本报告期末指数投资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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 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
同泰沪深 300 量化增强 A	1,383	48,854.92	11.93	0.00%	67,566,348.38	100.00%
同泰沪深 300 量化增强 C	2,517	7,684.30	-	0.00%	19,341,392.59	100.00%
合计	3,900	22,284.04	11.93	0.00%	86,907,740.97	100.00%

### 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	同泰沪深 300 量化增强 A	306.31	0.0005%
	同泰沪深 300 量化增强 C	3,030.86	0.0157%
	合计	3,337.17	0.0038%

### 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的情况

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	同泰沪深 300 量化增强 A	0~10
	同泰沪深 300 量化增强 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	同泰沪深 300 量化增强 A	0
	同泰沪深 300 量化增强 C	0~10
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	同泰沪深 300 量化增强 A	同泰沪深 300 量化增强 C
基金合同生效日（2021 年 7 月 23 日）基金份额总额	112,206,295.95	89,415,008.64
本报告期期初基金份额总额	78,962,286.83	21,889,451.32
本报告期基金总申购份额	6,859,820.13	10,296,195.31
减：本报告期基金总赎回份额	18,255,746.65	12,844,254.04
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	67,566,360.31	19,341,392.59

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 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上会会计师事务所(特殊普通合伙)。

## 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，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，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国海证券	2	120,565,013.38	76.10%	87,582.46	76.21%	
华宝证券	2	27,069,293.45	17.08%	19,533.04	17.00%	
东兴证券	2	10,805,789.19	6.82%	7,802.90	6.79%	

注：1、本基金使用券商结算模式。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准主要包括：公司基本面评价(财务状况、资信状况、经营状况)；公司信息服务评价(全面性、及时性和高效性)等方面。

### 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

本基金未使用所租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

## 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	同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定的媒介	2023 年 1 月 20 日
2	同泰基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2023 年 3 月 13 日

3	同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定的媒介	2023 年 3 月 30 日
4	同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定的媒介	2023 年 4 月 20 日
5	同泰基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2023 年 6 月 28 日

## § 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

因本基金管理人第一届董事会任期届满，经股东会决议，选举马俊生先生、王雪梅女士、刘韞芬女士、韩世君先生、方仲友先生、徐文学先生担任第二届董事会董事。同时，原董事长刘文灿先生因任期届满离任，由总经理马俊生先生代为履行职务。

上述事项已于 2023 年 8 月 12 日在中国证监会指定的媒介上公告。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金基金合同》；
- 2、《同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金托管协议》；
- 3、报告期内同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金公告的各项原稿。

### 12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的住所或办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)或者基金管理人网站([www.tongtaiamc.com](http://www.tongtaiamc.com))查阅，或在营业时间内至基金管理人住所免费查阅。

同泰基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日