

南方沪深 300 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	59
§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.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	南方沪深 300 指数增强	
基金主代码	009059	
交易代码	009059	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 23 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	155,649,288.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方沪深 300 指数增强 A	南方沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	009059	009060
报告期末下属分级基金的份 额总额	110,262,350.00 份	45,386,938.77 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，立足价值投资理念深入研究筛选，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过主动投资基本面优秀、估值合理的个股的方式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	本基金通过指数复制和主动选股相结合的策略，追求接近或超过标的指数的业绩表现。本基金为增强型指数基金，股票投资比例为基金资产的 90%-95%，其中沪深 300 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 80%。除因分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对固定的股票投资比例。如因特殊情况导致基金无法获得足够数量的股票时，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，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+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，一般而言，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。

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	南方基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	常克川	张姗
	联系电话	0755-82763888	0755-83077987
	电子邮箱	manager@southernfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95555
传真		0755-82763889	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518017	518040
法定代表人		周易	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、南方沪深 300 指数增强 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	731,054.15
本期利润	-37,958.71
加权平均基金份额本期利润	-0.0003
本期加权平均净值利润率	-0.03%
本期基金份额净值增长率	-0.08%
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	12,739,125.70

期末可供分配基金份额利润	0.1155
期末基金资产净值	123,001,475.70
期末基金份额净值	1.1155
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	11.55%

2、南方沪深 300 指数增强 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)
本期已实现收益	158,939.72
本期利润	-121,689.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0028
本期加权平均净值利润率	-0.25%
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 6 月 30 日)
期末可供分配利润	4,602,252.93
期末可供分配基金份额利润	0.1014
期末基金资产净值	49,989,191.70
期末基金份额净值	1.1014
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	10.14%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方沪深 300 指数增强 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	2.08%	0.81%	1.10%	0.83%	0.98%	-0.02%
过去三个月	-3.31%	0.75%	-4.88%	0.79%	1.57%	-0.04%
过去六个月	-0.08%	0.74%	-0.69%	0.80%	0.61%	-0.06%
过去一年	-16.39%	0.89%	-13.60%	0.94%	-2.79%	-0.05%
过去三年	0.43%	1.13%	-7.07%	1.14%	7.50%	-0.01%
自基金合同	11.55%	1.12%	0.39%	1.12%	11.16%	0.00%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

南方沪深 300 指数增强 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	2.05%	0.81%	1.10%	0.83%	0.95%	-0.02%
过去三个月	-3.40%	0.75%	-4.88%	0.79%	1.48%	-0.04%
过去六个月	-0.27%	0.74%	-0.69%	0.80%	0.42%	-0.06%
过去一年	-16.72%	0.89%	-13.60%	0.94%	-3.12%	-0.05%
过去三年	-0.77%	1.13%	-7.07%	1.14%	6.30%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	10.14%	1.12%	0.39%	1.12%	9.75%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方沪深300指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方沪深300指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理	证券	说明
----	----	-----------	----	----

		(助理) 期限		从业年限	
		任职日期	离任日期		
解锐	本基金基金经理	2022 年 2 月 18 日	-	5 年	清华大学金融专业硕士，具有基金从业资格。2017 年 7 月加入南方基金，任数量化投资部量化研究员；2020 年 8 月 10 日至 2022 年 2 月 18 日，任投资经理；2022 年 2 月 18 日至今，任南方沪深 300 增强、大数据 300 基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年一季度，本基金投资以量化指数增强模型选股投资为主。量化选股股票投资部分：使用多因子，量化基本面，事件驱动等模型，以多策略融合模型进行股票投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.1155 元，报告期内，份额净值增长率为-0.08%，同期业绩基准增长率为-0.69%；本基金 C 份额净值为 1.1014 元，报告期内，份额净值增长率为-0.27%，同期业绩基准增长率为-0.69%。

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 2023 年下半年，国内经济具备复苏空间，但信用扩张政策节制的情况下，需要更多耐心。美国经济或已现硬着陆前兆，下半年失业率或明显抬升，衰退风险未解除，降息预期有望重燃。在上述宏观条件组合的情况下，我们认为 A 股仍具备投资价值，结构或偏向小盘和低估值风格。我们将保持量化策略的定力，综合考虑性价比，力争依靠优秀的量化选股模型来获取超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管职责中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款,对托管产品的投资行为进行监督,并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则,独立地设置、登录和保管本产品的全套账册,进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方沪深 300 指数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	6.4.3.1	13,603,225.29	15,402,166.35
结算备付金		564,876.95	448,200.53
存出保证金		20,410.29	29,240.57
交易性金融资产	6.4.3.2	159,292,242.80	154,836,767.03
其中：股票投资		159,292,242.80	154,836,767.03
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	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		152,740.78	1,873,985.32
应收股利		-	-
应收申购款		75,083.42	219,550.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		173,708,579.53	172,809,909.98
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	3,435,040.33
应付赎回款		128,373.14	77,119.44
应付管理人报酬		70,733.49	71,654.81
应付托管费		14,146.69	14,330.96
应付销售服务费		16,280.15	15,723.78
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	6.4.3.6	488,378.66	564,506.25
负债合计		717,912.13	4,178,375.57
净资产：			

实收基金	6.4.3.7	155,649,288.77	151,503,862.48
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	17,341,378.63	17,127,671.93
净资产合计		172,990,667.40	168,631,534.41
负债和净资产总计		173,708,579.53	172,809,909.98

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，南方沪深 300 指数增强 A 份额净值 1.1155 元，基金份额总额 110,262,350.00 份；南方沪深 300 指数增强 C 份额净值 1.1014 元，基金份额总额 45,386,938.77 份；总份额合计 155,649,288.77 份。

6.2 利润表

会计主体：南方沪深 300 指数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
一、营业总收入		646,308.98	-32,677,283.03
1.利息收入		26,281.35	41,976.04
其中：存款利息收入	6.4.3.9	26,281.35	41,976.04
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）		1,652,933.11	-16,129,334.57
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-596,263.93	-17,940,673.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	5,066.72	174,955.12
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.12	-	-378,938.74
股利收益	6.4.3.13	2,244,130.32	2,015,323.00
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	6.4.3.14	-1,049,642.24	-16,660,863.17

失以“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.3.15	16,736.76	70,938.67
减:二、营业总支出		805,957.35	930,086.51
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	434,948.82	545,247.05
2.托管费	6.4.6.2.2	86,989.63	109,049.41
3.销售服务费	6.4.6.2.3	97,071.98	87,280.91
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		0.03	0.17
8.其他费用	6.4.3.16	186,946.89	188,508.97
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-159,648.37	-33,607,369.54
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-159,648.37	-33,607,369.54
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-159,648.37	-33,607,369.54

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体:南方沪深 300 指数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)	151,503,862.48	-	17,127,671.93	168,631,534.41
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)	151,503,862.48	-	17,127,671.93	168,631,534.41
三、本期增减变动额(减少以	4,145,426.29	-	213,706.70	4,359,132.99

“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-159,648.37	-159,648.37
(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)	4,145,426.29	-	373,355.07	4,518,781.36
其中: 1.基金申购款	23,639,611.27	-	3,292,420.41	26,932,031.68
2.基金赎回款	-19,494,184.98	-	-2,919,065.34	-22,413,250.32
(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)	155,649,288.77	-	17,341,378.63	172,990,667.40
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)	206,932,312.24	-	97,944,064.46	304,876,376.70
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)	206,932,312.24	-	97,944,064.46	304,876,376.70
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-66,582,056.77	-	-51,431,253.74	-118,013,310.51
(一)、综合收益总额	-	-	-33,607,369.54	-33,607,369.54
(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)	-66,582,056.77	-	-17,823,884.20	-84,405,940.97

其中：1.基金申购款	33,591,421.24	-	9,327,859.99	42,919,281.23
2.基金赎回款	-100,173,478.01	-	-27,151,744.19	-127,325,222.20
(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）	140,350,255.47	-	46,512,810.72	186,863,066.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	13,603,225.29

等于：本金	13,601,979.42
加：应计利息	1,245.87
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	13,603,225.29

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	166,240,719.63	-	159,292,242.80	-6,948,476.83
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	166,240,719.63	-	159,292,242.80	-6,948,476.83

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9.20
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	354,066.90
其中：交易所市场	354,066.90
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	50,000.00
合计	488,378.66

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方沪深 300 指数增强 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	109,487,223.75	109,487,223.75
本期申购	12,465,241.73	12,465,241.73
本期赎回（以“-”号填列）	-11,690,115.48	-11,690,115.48
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	110,262,350.00	110,262,350.00

南方沪深 300 指数增强 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	42,016,638.73	42,016,638.73
本期申购	11,174,369.54	11,174,369.54
本期赎回（以“-”号填列）	-7,804,069.50	-7,804,069.50
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	45,386,938.77	45,386,938.77

6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

南方沪深 300 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,584,404.50	-5,843,580.30	12,740,824.20
本期利润	731,054.15	-769,012.86	-37,958.71
本期基金份额交易产生的变动数	128,027.95	-91,767.74	36,260.21
其中：基金申购款	2,161,289.26	-328,059.35	1,833,229.91
基金赎回款	-2,033,261.31	236,291.61	-1,796,969.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,443,486.60	-6,704,360.90	12,739,125.70

南方沪深 300 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,562,251.00	-2,175,403.27	4,386,847.73
本期利润	158,939.72	-280,629.38	-121,689.66
本期基金份额交易产生的变动数	561,321.69	-224,226.83	337,094.86
其中：基金申购款	1,769,390.50	-310,200.00	1,459,190.50
基金赎回款	-1,208,068.81	85,973.17	-1,122,095.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,282,512.41	-2,680,259.48	4,602,252.93

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,954.86
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	4,798.70
其他	527.79
合计	26,281.35

6.4.3.10 股票投资收益

6.4.3.10.1 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	411,933,127.66
减：卖出股票成本总额	411,304,870.58

减：交易费用	1,224,521.01
买卖股票差价收入	-596,263.93

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.11 债券投资收益

6.4.3.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	6.61
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	5,060.11
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	5,066.72

6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	34,068.45
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	29,000.00
减：应计利息总额	6.97
减：交易费用	1.37
买卖债券差价收入	5,060.11

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.3.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.3.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.3.12 衍生工具收益

6.4.3.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.3.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.3.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,244,130.32
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	2,244,130.32

6.4.3.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-1,049,642.24
——股票投资	-1,049,642.24
——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	-
——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,049,642.24

6.4.3.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	14,288.83
基金转换费收入	2,447.93
合计	16,736.76

6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
银行费用	2,644.33
合计	186,946.89

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 50,000 元。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	-	-	2,140,474.36	0.18%

6.4.6.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	-	-	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	1,016.71	0.10%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	434,948.82	545,247.05
其中：支付销售机构的客户维护费	143,471.30	161,953.61

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	86,989.63	109,049.41

注：支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 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。

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	南方沪深 300 指数增强 A	南方沪深 300 指数增强 C	合计
华泰证券	-	1,703.06	1,703.06
南方基金	-	18,677.47	18,677.47
招商银行	-	16,206.29	16,206.29

合计	-	36,586.82	36,586.82
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		
	南方沪深 300 指数增强 A	南方沪深 300 指数增强 C	合计
华泰证券	-	1,989.71	1,989.71
南方基金	-	21,639.49	21,639.49
招商银行	-	17,402.51	17,402.51
合计	-	41,031.71	41,031.71

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至
-------	-----------------------------	-------------------------

	月 30 日		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
招商银行	13,603,225.29	20,954.86	14,729,116.70	30,403.61

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

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	688472	阿特斯	网下申购	7,164	79,520.40
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	2,006	65,235.12
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	2,847	59,559.24
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	2,022	38,822.40
华泰联合	118031	天 23 转债	配债	270	27,000.00
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券	301322	绿通科技	网下申购	538	70,537.18
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	1,543	49,823.47
兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	网下申购	20,354	115,814.26
兴业证券,华泰联合	601916	浙商银行	配股	25,530	51,570.60

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	110085	通 22 转债	配债	2,140	214,000.00
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	5,964	134,368.92
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	1,594	128,795.20
华泰联合	113055	成银转债	配债	1,200	120,000.00
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	1,756	99,881.28

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688515	裕太微	2023年2月1日	6个月	新股锁定期	92.00	162.75	897	82,524.00	145,986.75	-
601916	浙商银行	2023年6月27日	1个月内(含)	配股未上市	2.02	2.64	25,530	51,570.60	67,399.20	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	1,051	60,600.66	60,600.66	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	1,278	50,838.84	50,838.84	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股锁定期	39.78	39.78	143	5,688.54	5,688.54	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	834	45,870.00	45,870.00	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,155	42,619.50	42,619.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	1,365	35,244.30	35,244.30	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定期	25.82	25.82	152	3,924.64	3,924.64	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股锁定期	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定期	19.86	18.06	1,074	21,329.64	19,396.44	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股锁定期	29.60	71.42	177	5,239.20	12,641.34	-

688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	11.10	17.04	717	7,958.70	12,217.68	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	23.60	64.67	173	4,082.80	11,187.91	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	5.69	5.41	2,036	11,584.84	11,014.76	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	20.67	26.17	417	8,619.39	10,912.89	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	13.06	20.62	501	6,543.06	10,330.62	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	76.80	107.9 5	91	6,988.80	9,823.45	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	23.77	42.89	229	5,443.33	9,821.81	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	37.88	29.49	321	12,159.48	9,466.29	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	9.26	18.59	476	4,407.76	8,848.84	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	32.52	42.37	201	6,536.52	8,516.37	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	30.85	23.63	352	10,859.20	8,317.76	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	32.29	51.12	155	5,004.95	7,923.60	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	12.68	22.31	346	4,387.28	7,719.26	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	135.8 0	120.4 1	63	8,555.40	7,585.83	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月	6 个月	新股锁 定期	26.74	40.68	178	4,759.72	7,241.04	-

		21 日								
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定期	23.80	32.84	219	5,212.20	7,191.96	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定期	36.15	38.13	171	6,181.65	6,520.23	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期	75.00	90.76	71	5,325.00	6,443.96	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁定期	10.68	12.34	519	5,542.92	6,404.46	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期	37.40	36.07	176	6,582.40	6,348.32	-
688352	硕中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定期	12.10	12.07	516	6,243.60	6,228.12	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁定期	14.16	16.21	352	4,984.32	5,705.92	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁定期	43.67	53.05	106	4,629.02	5,623.30	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定期	20.92	19.16	285	5,962.20	5,460.60	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定期	35.00	51.23	105	3,675.00	5,379.15	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁定期	30.26	25.33	212	6,415.12	5,369.96	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定期	17.55	16.75	316	5,545.80	5,293.00	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁定期	19.20	25.53	203	3,897.60	5,182.59	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定期	50.00	48.39	105	5,250.00	5,080.95	-
688433	华曙高科	2023	6 个月	新股锁	26.66	31.50	161	4,292.26	5,071.50	-

		年 4 月 7 日		定期							
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	33.73	31.85	159	5,363.07	5,064.15	-	
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	11.88	21.02	237	2,815.56	4,981.74	-	
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	26.35	30.60	155	4,084.25	4,743.00	-	
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	24.66	22.51	203	5,005.98	4,569.53	-	
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	72.50	58.42	78	5,655.00	4,556.76	-	
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	32.60	30.37	145	4,727.00	4,403.65	-	
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	46.13	34.40	128	5,904.64	4,403.20	-	
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	19.99	16.90	257	5,137.43	4,343.30	-	
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	131.1 1	53.24	54	7,079.94	2,874.96	-	
301322	绿通科技	2023 年 5 月 25 日	1-6 个 月(含)	锁定期 转增	-	53.24	27	-	1,437.48	-	
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	56.50	52.93	81	4,576.50	4,287.33	-	
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	6.58	7.58	558	3,671.64	4,229.64	-	
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	25.28	29.87	140	3,539.20	4,181.80	-	
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	39.06	39.36	106	4,140.36	4,172.16	-	

688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	125.8 8	86.79	48	6,042.24	4,165.92	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	33.99	29.49	122	4,146.78	3,597.78	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	73.45	46.64	70	5,141.50	3,264.80	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	11.66	12.26	185	2,157.10	2,268.10	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	10.36	11.84	190	1,968.40	2,249.60	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	20.68	25.49	78	1,613.04	1,988.22	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	18.88	19.60	95	1,793.60	1,862.00	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	25.98	24.53	61	1,584.78	1,496.33	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	15.38	14.87	98	1,507.24	1,457.26	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	44.48	39.48	34	1,512.32	1,342.32	-

6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

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

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股票 名称	停牌日期	停牌 原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌开 盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
----------	----------	------	----------	----------------	----------	------------	--------	--------	--------	----

601298	青岛港	2023 年 6 月 28 日	重大事项停牌	6.97	2023 年 7 月 3 日	7.40	3,000	22,014.00	20,910.00	-
--------	-----	-----------------	--------	------	----------------	------	-------	-----------	-----------	---

本基金截至 2023 年 06 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。本基金为指数型基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的

限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围之内。

6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.9.3 流动性风险

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

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

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限

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。

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

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

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	13,603,225.29	-	-	-	13,603,225.29
结算备付金	564,876.95	-	-	-	564,876.95
存出保证金	20,410.29	-	-	-	20,410.29
交易性金融资产	-	-	-	159,292,242.80	159,292,242.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	152,740.78	152,740.78
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	18,951.00	-	-	56,132.42	75,083.42
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,207,463.53	-	-	159,501,116.00	173,708,579.53
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	128,373.14	128,373.14
应付管理人报酬	-	-	-	70,733.49	70,733.49
应付托管费	-	-	-	14,146.69	14,146.69
应付销售服务费	-	-	-	16,280.15	16,280.15
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	-	-	-	488,378.66	488,378.66
负债总计	-	-	-	717,912.13	717,912.13
利率敏感度 缺口	14,207,463.5 3	-	-	158,783,203. 87	172,990,667. 40
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	15,402,166.3 5	-	-	-	15,402,166.3 5
结算备付金	448,200.53	-	-	-	448,200.53
存出保证金	29,240.57	-	-	-	29,240.57
交易性金融 资产	-	-	-	154,836,767. 03	154,836,767. 03
衍生金融资 产	-	-	-	-	-
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投 资	-	-	-	-	-
其他权益工 具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,873,985.32	1,873,985.32
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	33,955.00	-	-	185,595.18	219,550.18
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	15,913,562.4 5	-	-	156,896,347. 53	172,809,909. 98
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融 负债	-	-	-	-	-
衍生金融负 债	-	-	-	-	-
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	3,435,040.33	3,435,040.33
应付赎回款	-	-	-	77,119.44	77,119.44
应付管理人	-	-	-	71,654.81	71,654.81

报酬					
应付托管费	-	-	-	14,330.96	14,330.96
应付销售服务费	-	-	-	15,723.78	15,723.78
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	-	-	-	564,506.25	564,506.25
负债总计	-	-	-	4,178,375.57	4,178,375.57
利率敏感度缺口	15,913,562.45	-	-	152,717,971.96	168,631,534.41

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	0.00	0.00
2.市场利率平行下降 25 个基点	0.00	0.00	

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整，通过指数化分散投资降低其他价格风险。

本基金股票（含存托凭证）资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对

本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	159,292,242.80	92.08	154,836,767.03	91.82
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	159,292,242.80	92.08	154,836,767.03	91.82

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	7,464,311.87	7,661,036.73
	2.组合自身基准下降 5%	-7,464,311.87	-7,661,036.73

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
---------------	---------------------

第一层次	158,433,534.10
第二层次	333,095.68
第三层次	525,613.02
合计	159,292,242.80

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	159,292,242.80	91.70
	其中：股票	159,292,242.80	91.70
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	14,168,102.24	8.16
8	其他资产	248,234.49	0.14

9	合计	173,708,579.53	100.00
---	----	----------------	--------

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	598,530.00	0.35
B	采矿业	4,251,265.00	2.46
C	制造业	83,048,180.55	48.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,267,619.00	2.47
E	建筑业	5,866,667.04	3.39
F	批发和零售业	104,088.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	5,703,451.00	3.30
H	住宿和餐饮业	296,380.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,550,454.56	2.63
J	金融业	27,892,081.90	16.12
K	房地产业	1,638,458.00	0.95
L	租赁和商务服务业	1,979,076.00	1.14
M	科学研究和技术服务业	236,568.00	0.14
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	605,305.05	0.35
R	文化、体育和娱乐业	759,462.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	141,797,586.10	81.97

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

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	35,798.00	0.02
B	采矿业	1,025,956.00	0.59
C	制造业	12,399,451.16	7.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.02
E	建筑业	11,244.10	0.01
F	批发和零售业	798,817.63	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	835,574.70	0.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	471,702.29	0.27
J	金融业	1,185,103.20	0.69

K	房地产业	77,623.00	0.04
L	租赁和商务服务业	203,648.80	0.12
M	科学研究和技术服务业	114,538.34	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	152,014.17	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	86,555.84	0.05
R	文化、体育和娱乐业	61,182.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	17,494,656.70	10.11

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投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 报告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

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	600519	贵州茅台	3,100	5,242,100.00	3.03
2	601318	中国平安	92,100	4,273,440.00	2.47
3	300750	宁德时代	15,240	3,486,759.60	2.02
4	600919	江苏银行	405,100	2,977,485.00	1.72
5	000858	五粮液	14,400	2,355,408.00	1.36
6	601618	中国中冶	588,312	2,335,598.64	1.35
7	300316	晶盛机电	32,892	2,332,042.80	1.35
8	688599	天合光能	53,411	2,275,842.71	1.32
9	000333	美的集团	38,100	2,244,852.00	1.30
10	601336	新华保险	60,550	2,226,423.50	1.29
11	002129	TCL 中环	64,125	2,128,950.00	1.23
12	000568	泸州老窖	10,107	2,118,123.99	1.22
13	002459	晶澳科技	50,480	2,105,016.00	1.22
14	000596	古井贡酒	8,300	2,053,254.00	1.19
15	603369	今世缘	38,300	2,022,240.00	1.17
16	600039	四川路桥	198,240	1,944,734.40	1.12
17	600926	杭州银行	157,552	1,851,236.00	1.07
18	601012	隆基绿能	64,200	1,840,614.00	1.06
19	000001	平安银行	147,200	1,653,056.00	0.96
20	600309	万华化学	18,400	1,616,256.00	0.93
21	601818	光大银行	490,800	1,506,756.00	0.87
22	000338	潍柴动力	117,500	1,464,050.00	0.85
23	600674	川投能源	93,600	1,408,680.00	0.81

24	000538	云南白药	26,800	1,406,464.00	0.81
25	601166	兴业银行	88,800	1,389,720.00	0.80
26	601100	恒立液压	21,600	1,389,528.00	0.80
27	601169	北京银行	294,100	1,361,683.00	0.79
28	300433	蓝思科技	111,400	1,310,064.00	0.76
29	601601	中国太保	46,500	1,208,070.00	0.70
30	601600	中国铝业	219,500	1,205,055.00	0.70
31	002352	顺丰控股	26,400	1,190,376.00	0.69
32	603195	公牛集团	11,248	1,080,482.88	0.62
33	601888	中国中免	9,600	1,061,088.00	0.61
34	603833	欧派家居	11,000	1,053,800.00	0.61
35	600031	三一重工	62,500	1,039,375.00	0.60
36	002304	洋河股份	7,800	1,024,530.00	0.59
37	300896	爱美客	2,300	1,023,385.00	0.59
38	000725	京东方 A	248,600	1,016,774.00	0.59
39	002594	比亚迪	3,910	1,009,835.70	0.58
40	000651	格力电器	26,700	974,817.00	0.56
41	600803	新奥股份	50,900	966,082.00	0.56
42	600089	特变电工	42,700	951,783.00	0.55
43	601088	中国神华	30,300	931,725.00	0.54
44	603993	洛阳钼业	173,300	923,689.00	0.53
45	002027	分众传媒	134,800	917,988.00	0.53
46	300274	阳光电源	7,800	909,714.00	0.53
47	601319	中国人保	155,400	907,536.00	0.52
48	600000	浦发银行	123,900	897,036.00	0.52
49	600600	青岛啤酒	8,400	870,492.00	0.50
50	002371	北方华创	2,700	857,655.00	0.50
51	300760	迈瑞医疗	2,800	839,440.00	0.49
52	603288	海天味业	17,760	832,056.00	0.48
53	600009	上海机场	18,300	831,186.00	0.48
54	300450	先导智能	22,800	824,676.00	0.48
55	000786	北新建材	33,500	821,085.00	0.47
56	002050	三花智控	27,100	820,046.00	0.47
57	002410	广联达	25,060	814,199.40	0.47
58	600028	中国石化	127,500	810,900.00	0.47
59	601615	明阳智能	47,900	808,552.00	0.47
60	601816	京沪高铁	147,200	774,272.00	0.45
61	300413	芒果超媒	22,200	759,462.00	0.44
62	600809	山西汾酒	4,100	758,787.00	0.44
63	002271	东方雨虹	27,800	757,828.00	0.44
64	603799	华友钴业	16,300	748,333.00	0.43
65	600436	片仔癀	2,600	744,536.00	0.43
66	000002	万科 A	53,100	744,462.00	0.43

67	002179	中航光电	16,390	743,286.50	0.43
68	000408	藏格矿业	32,900	742,553.00	0.43
69	600016	民生银行	197,800	741,750.00	0.43
70	688303	大全能源	18,313	740,760.85	0.43
71	600570	恒生电子	16,700	739,643.00	0.43
72	600233	圆通速递	50,700	738,192.00	0.43
73	600584	长电科技	23,500	732,495.00	0.42
74	300957	贝泰妮	8,100	719,928.00	0.42
75	601838	成都银行	58,200	710,622.00	0.41
76	600183	生益科技	49,600	704,320.00	0.41
77	300207	欣旺达	42,800	698,496.00	0.40
78	002236	大华股份	35,200	695,200.00	0.40
79	605117	德业股份	4,608	689,126.40	0.40
80	300122	智飞生物	15,450	682,890.00	0.39
81	600015	华夏银行	124,100	671,381.00	0.39
82	603806	福斯特	17,640	656,031.60	0.38
83	600132	重庆啤酒	6,700	617,472.00	0.36
84	601225	陕西煤业	33,700	613,003.00	0.35
85	300015	爱尔眼科	32,631	605,305.05	0.35
86	600886	国投电力	47,600	602,140.00	0.35
87	002714	牧原股份	14,200	598,530.00	0.35
88	601919	中远海控	63,100	593,140.00	0.34
89	600048	保利发展	45,500	592,865.00	0.34
90	300782	卓胜微	6,000	579,780.00	0.34
91	688363	华熙生物	6,456	575,616.96	0.33
92	600585	海螺水泥	23,300	553,142.00	0.32
93	002311	海大集团	11,600	543,344.00	0.31
94	601021	春秋航空	9,400	540,218.00	0.31
95	600050	中国联通	111,200	533,760.00	0.31
96	601728	中国电信	94,400	531,472.00	0.31
97	002466	天齐锂业	7,600	531,316.00	0.31
98	600900	长江电力	23,900	527,234.00	0.30
99	600362	江西铜业	26,900	510,562.00	0.30
100	601899	紫金矿业	44,400	504,828.00	0.29
101	002142	宁波银行	19,400	490,820.00	0.28
102	601211	国泰君安	34,000	475,660.00	0.27
103	300033	同花顺	2,700	473,256.00	0.27
104	601398	工商银行	97,100	468,022.00	0.27
105	600426	华鲁恒升	15,100	462,513.00	0.27
106	688126	沪硅产业	22,093	461,743.70	0.27
107	300763	锦浪科技	4,400	458,040.00	0.26
108	300751	迈为股份	2,700	457,326.00	0.26
109	600438	通威股份	13,000	446,030.00	0.26

110	003816	中国广核	140,400	436,644.00	0.25
111	000625	长安汽车	32,000	413,760.00	0.24
112	002475	立讯精密	12,600	408,870.00	0.24
113	601186	中国铁建	41,500	408,775.00	0.24
114	600690	海尔智家	17,000	399,160.00	0.23
115	002756	永兴材料	6,360	398,199.60	0.23
116	601138	工业富联	15,800	398,160.00	0.23
117	601988	中国银行	100,800	394,128.00	0.23
118	600941	中国移动	4,200	391,860.00	0.23
119	600029	南方航空	63,000	379,890.00	0.22
120	601669	中国电建	64,900	372,526.00	0.22
121	000157	中联重科	54,800	369,900.00	0.21
122	000425	徐工机械	53,200	360,164.00	0.21
123	000708	中信特钢	22,500	356,400.00	0.21
124	002415	海康威视	10,600	350,966.00	0.20
125	300408	三环集团	11,800	346,330.00	0.20
126	605499	东鹏饮料	2,000	345,800.00	0.20
127	002074	国轩高科	12,200	336,964.00	0.19
128	600875	东方电气	18,000	335,700.00	0.19
129	002601	龙佰集团	20,200	333,300.00	0.19
130	601877	正泰电器	11,800	326,270.00	0.19
131	300454	深信服	2,800	317,100.00	0.18
132	601390	中国中铁	41,800	316,844.00	0.18
133	600837	海通证券	34,100	314,402.00	0.18
134	002555	三七互娱	9,000	313,920.00	0.18
135	002252	上海莱士	40,400	303,404.00	0.18
136	002736	国信证券	34,200	298,566.00	0.17
137	600754	锦江酒店	7,000	296,380.00	0.17
138	600918	中泰证券	42,000	290,220.00	0.17
139	600196	复星医药	9,300	287,370.00	0.17
140	002120	韵达股份	28,100	268,636.00	0.16
141	603899	晨光股份	6,000	267,840.00	0.15
142	600030	中信证券	13,500	267,030.00	0.15
143	600660	福耀玻璃	7,400	265,290.00	0.15
144	002202	金风科技	24,800	263,376.00	0.15
145	600085	同仁堂	4,500	259,020.00	0.15
146	600741	华域汽车	13,600	251,056.00	0.15
147	300059	东方财富	17,600	249,920.00	0.14
148	002648	卫星化学	16,700	249,832.00	0.14
149	600383	金地集团	34,300	247,303.00	0.14
150	600588	用友网络	12,000	246,000.00	0.14
151	300014	亿纬锂能	4,000	242,000.00	0.14
152	601229	上海银行	41,900	240,925.00	0.14

153	688187	时代电气	5,720	239,439.20	0.14
154	600019	宝钢股份	42,100	236,602.00	0.14
155	600061	国投资本	33,100	235,672.00	0.14
156	600011	华能国际	25,400	235,204.00	0.14
157	600219	南山铝业	76,800	231,936.00	0.13
158	000938	紫光股份	7,200	229,320.00	0.13
159	601939	建设银行	34,300	214,718.00	0.12
160	600606	绿地控股	76,900	211,475.00	0.12
161	600332	白云山	6,000	191,280.00	0.11
162	601857	中国石油	25,600	191,232.00	0.11
163	601288	农业银行	53,900	190,267.00	0.11
164	601698	中国卫通	9,500	188,860.00	0.11
165	601111	中国国航	22,300	183,752.00	0.11
166	601628	中国人寿	5,200	181,792.00	0.11
167	600989	宝丰能源	14,300	180,323.00	0.10
168	688111	金山办公	372	175,665.84	0.10
169	300347	泰格医药	2,700	174,258.00	0.10
170	603486	科沃斯	2,200	171,094.00	0.10
171	002230	科大讯飞	2,500	169,900.00	0.10
172	603185	弘元绿能	2,200	164,010.00	0.09
173	601881	中国银河	14,100	163,701.00	0.09
174	300124	汇川技术	2,500	160,525.00	0.09
175	601668	中国建筑	27,000	154,980.00	0.09
176	688561	奇安信	2,472	128,074.32	0.07
177	601006	大秦铁路	15,900	118,137.00	0.07
178	000963	华东医药	2,400	104,088.00	0.06
179	601998	中信银行	17,000	101,660.00	0.06
180	600188	兖矿能源	3,000	89,760.00	0.05
181	601766	中国中车	13,000	84,500.00	0.05
182	600176	中国巨石	5,800	82,128.00	0.05
183	000895	双汇发展	3,000	73,470.00	0.04
184	600958	东方证券	7,212	69,956.40	0.04
185	601117	中国化学	8,400	69,552.00	0.04
186	000776	广发证券	4,500	66,195.00	0.04
187	601699	潞安环能	4,000	65,280.00	0.04
188	000166	申万宏源	14,000	64,680.00	0.04
189	601066	中信建投	2,600	62,920.00	0.04
190	601216	君正集团	15,300	62,730.00	0.04
191	603259	药明康德	1,000	62,310.00	0.04
192	600018	上港集团	11,600	60,900.00	0.04
193	300142	沃森生物	2,300	60,835.00	0.04
194	300999	金龙鱼	1,500	59,985.00	0.03
195	600887	伊利股份	2,100	59,472.00	0.03

196	600905	三峡能源	11,000	59,070.00	0.03
197	601898	中煤能源	6,300	53,172.00	0.03
198	601868	中国能建	22,300	52,182.00	0.03
199	000792	盐湖股份	2,700	51,759.00	0.03
200	600760	中航沈飞	1,120	50,400.00	0.03
201	601878	浙商证券	5,000	49,400.00	0.03
202	601788	光大证券	3,000	47,670.00	0.03
203	601995	中金公司	1,300	46,176.00	0.03
204	001979	招商蛇口	3,400	44,302.00	0.03
205	688065	凯赛生物	678	42,212.28	0.02
206	600547	山东黄金	1,700	39,916.00	0.02
207	601901	方正证券	5,900	38,586.00	0.02
208	000768	中航西飞	1,400	37,450.00	0.02
209	688981	中芯国际	734	37,081.68	0.02
210	002460	赣锋锂业	600	36,576.00	0.02
211	600150	中国船舶	1,000	32,910.00	0.02
212	300661	圣邦股份	390	32,030.70	0.02
213	601985	中国核电	4,300	30,315.00	0.02
214	002001	新和成	1,900	29,260.00	0.02
215	601808	中海油服	2,000	27,760.00	0.02
216	603659	璞泰来	700	26,754.00	0.02
217	600115	中国东航	5,200	24,752.00	0.01
218	601689	拓普集团	300	24,210.00	0.01
219	601633	长城汽车	900	22,653.00	0.01
220	002049	紫光国微	200	18,650.00	0.01
221	601238	广汽集团	1,600	16,672.00	0.01
222	002920	德赛西威	100	15,581.00	0.01
223	601989	中国重工	2,700	13,014.00	0.01
224	601799	星宇股份	100	12,360.00	0.01
225	601328	交通银行	1,700	9,860.00	0.01
226	601236	红塔证券	1,300	9,685.00	0.01
227	000733	振华科技	100	9,585.00	0.01
228	601155	新城控股	600	8,646.00	0.00
229	000800	一汽解放	700	5,859.00	0.00
230	002414	高德红外	520	4,040.40	0.00
231	002064	华峰化学	500	3,430.00	0.00
232	000876	新希望	200	2,336.00	0.00
233	001289	龙源电力	100	2,250.00	0.00
234	000069	华侨城 A	200	880.00	0.00

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

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	002600	领益智造	232,400	1,605,884.00	0.93
2	002032	苏泊尔	21,200	1,060,000.00	0.61
3	601966	玲珑轮胎	43,200	959,904.00	0.55
4	601958	金钼股份	46,500	518,475.00	0.30
5	603368	柳药集团	14,200	350,882.00	0.20
6	688169	石头科技	1,053	337,676.04	0.20
7	603737	三棵树	5,040	329,716.80	0.19
8	600372	中航电子	21,697	329,360.46	0.19
9	600517	国网英大	57,500	327,750.00	0.19
10	603071	物产环能	19,500	323,505.00	0.19
11	002273	水晶光电	26,700	318,798.00	0.18
12	600060	海信视像	12,800	316,800.00	0.18
13	002223	鱼跃医疗	8,500	305,915.00	0.18
14	002422	科伦药业	10,300	305,704.00	0.18
15	601916	浙商银行	110,630	292,063.20	0.17
16	600348	华阳股份	36,900	291,879.00	0.17
17	601333	广深铁路	72,400	286,704.00	0.17
18	600066	宇通客车	18,700	275,638.00	0.16
19	600516	方大炭素	44,000	272,800.00	0.16
20	605077	华康股份	9,900	262,152.00	0.15
21	600582	天地科技	44,200	257,686.00	0.15
22	002966	苏州银行	35,600	233,180.00	0.13
23	000089	深圳机场	28,000	194,600.00	0.11
24	600377	宁沪高速	19,100	187,753.00	0.11
25	603605	珀莱雅	1,660	186,584.00	0.11
26	002832	比音勒芬	5,100	180,591.00	0.10
27	002372	伟星新材	8,100	166,374.00	0.10
28	603688	石英股份	1,300	147,992.00	0.09
29	600612	老凤祥	2,100	146,748.00	0.08
30	688515	裕太微	897	145,986.75	0.08
31	603868	飞科电器	2,300	145,107.00	0.08
32	600871	石化油服	72,800	144,144.00	0.08
33	300866	安克创新	1,600	140,000.00	0.08
34	002262	恩华药业	4,100	126,403.00	0.07
35	003006	百亚股份	7,200	124,416.00	0.07
36	688399	硕世生物	2,091	115,423.20	0.07
37	688443	智翔金泰	3,206	98,641.64	0.06
38	688088	虹软科技	2,216	94,734.00	0.05
39	600655	豫园股份	13,800	94,668.00	0.05
40	003012	东鹏控股	11,700	94,653.00	0.05
41	000785	居然之家	24,200	92,202.00	0.05
42	002518	科士达	2,200	88,022.00	0.05

43	688389	普门科技	3,664	86,067.36	0.05
44	688002	睿创微纳	1,831	82,028.80	0.05
45	605168	三人行	870	74,767.80	0.04
46	603882	金城医学	979	73,914.50	0.04
47	601717	郑煤机	5,800	72,210.00	0.04
48	601330	绿色动力	9,700	71,683.00	0.04
49	002985	北摩高科	1,600	70,592.00	0.04
50	301280	珠城科技	1,920	68,659.20	0.04
51	688601	力芯微	1,438	67,729.80	0.04
52	300146	汤臣倍健	2,800	67,144.00	0.04
53	600256	广汇能源	9,300	63,798.00	0.04
54	301029	怡合达	1,400	62,552.00	0.04
55	600906	财达证券	8,600	61,920.00	0.04
56	601456	国联证券	6,800	61,880.00	0.04
57	301486	致尚科技	1,051	60,600.66	0.04
58	601156	东航物流	4,600	59,800.00	0.03
59	605388	均瑶健康	4,700	59,737.00	0.03
60	300908	仲景食品	1,300	58,955.00	0.03
61	601375	中原证券	15,800	58,618.00	0.03
62	600179	安通控股	20,900	58,311.00	0.03
63	301356	天振股份	2,648	57,991.20	0.03
64	002939	长城证券	7,000	56,910.00	0.03
65	301488	豪恩汽电	1,421	56,527.38	0.03
66	600728	佳都科技	8,100	56,133.00	0.03
67	603360	百傲化学	5,460	55,364.40	0.03
68	301365	矩阵股份	3,327	54,762.42	0.03
69	603328	依顿电子	6,600	54,648.00	0.03
70	301223	中荣股份	2,851	53,370.72	0.03
71	002815	崇达技术	4,200	52,290.00	0.03
72	002244	滨江集团	5,900	52,038.00	0.03
73	688390	固德威	304	50,725.44	0.03
74	688037	芯源微	296	50,601.20	0.03
75	000728	国元证券	7,600	49,552.00	0.03
76	600633	浙数文化	3,000	48,630.00	0.03
77	603129	春风动力	300	48,570.00	0.03
78	300513	恒实科技	3,500	48,475.00	0.03
79	000623	吉林敖东	3,000	48,120.00	0.03
80	003040	楚天龙	2,600	47,164.00	0.03
81	301232	飞沃科技	780	47,161.14	0.03
82	688603	天承科技	834	45,870.00	0.03
83	301203	国泰环保	1,271	45,311.17	0.03
84	300724	捷佳伟创	400	44,940.00	0.03
85	603345	安井食品	300	44,040.00	0.03

86	002568	百润股份	1,200	43,620.00	0.03
87	605111	新洁能	1,000	43,520.00	0.03
88	002961	瑞达期货	3,000	43,230.00	0.02
89	688623	双元科技	473	43,210.67	0.02
90	301261	恒工精密	1,155	42,619.50	0.02
91	300855	图南股份	1,170	41,324.40	0.02
92	300902	国安达	1,100	41,195.00	0.02
93	688083	中望软件	280	40,569.20	0.02
94	600481	双良节能	2,900	40,542.00	0.02
95	002536	飞龙股份	2,700	40,500.00	0.02
96	600862	中航高科	1,600	40,496.00	0.02
97	688063	派能科技	200	39,650.00	0.02
98	688280	精进电动	4,358	39,614.22	0.02
99	688188	柏楚电子	210	39,597.60	0.02
100	301202	朗威股份	1,517	39,168.94	0.02
101	300940	南极光	2,300	39,123.00	0.02
102	688232	新点软件	724	38,958.44	0.02
103	002745	木林森	4,200	38,640.00	0.02
104	603515	欧普照明	1,900	38,570.00	0.02
105	688106	金宏气体	1,412	38,406.40	0.02
106	300894	火星人	1,500	38,310.00	0.02
107	002867	周大生	2,100	37,338.00	0.02
108	600312	平高电气	3,000	37,170.00	0.02
109	600415	小商品城	4,300	36,679.00	0.02
110	603317	天味食品	2,500	36,525.00	0.02
111	300294	博雅生物	1,000	36,280.00	0.02
112	000811	冰轮环境	2,300	36,248.00	0.02
113	002461	珠江啤酒	4,100	36,121.00	0.02
114	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
115	688006	杭可科技	1,163	35,436.61	0.02
116	300647	超频三	4,900	35,182.00	0.02
117	002739	万达电影	2,800	35,112.00	0.02
118	688299	长阳科技	2,239	35,085.13	0.02
119	603568	伟明环保	2,000	35,020.00	0.02
120	605378	野马电池	1,500	34,965.00	0.02
121	688198	佰仁医疗	329	34,910.19	0.02
122	688212	澳华内镜	511	34,696.90	0.02
123	301047	义翘神州	400	34,280.00	0.02
124	688538	和辉光电	13,211	33,555.94	0.02
125	301345	涛涛车业	696	33,131.26	0.02
126	000727	冠捷科技	15,600	33,072.00	0.02
127	603919	金徽酒	1,400	32,872.00	0.02
128	688055	龙腾光电	8,046	32,666.76	0.02

129	600298	安琪酵母	900	32,589.00	0.02
130	300363	博腾股份	1,100	32,549.00	0.02
131	600315	上海家化	1,100	31,911.00	0.02
132	688798	艾为电子	538	31,822.70	0.02
133	688029	南微医学	388	31,645.28	0.02
134	300685	艾德生物	1,300	31,538.00	0.02
135	300129	泰胜风能	3,200	30,688.00	0.02
136	300396	迪瑞医疗	900	29,241.00	0.02
137	603383	顶点软件	500	27,710.00	0.02
138	601921	浙版传媒	3,000	26,070.00	0.02
139	002935	天奥电子	1,300	25,714.00	0.01
140	001914	招商积余	1,700	25,585.00	0.01
141	600201	生物股份	2,600	24,726.00	0.01
142	603158	腾龙股份	3,200	24,512.00	0.01
143	601298	青岛港	3,000	20,910.00	0.01
144	300827	上能电气	572	20,620.60	0.01
145	300887	谱尼测试	500	19,790.00	0.01
146	300841	康华生物	300	19,767.00	0.01
147	300349	金卡智能	1,400	19,432.00	0.01
148	688249	晶合集成	1,074	19,396.44	0.01
149	002014	永新股份	2,200	19,096.00	0.01
150	600598	北大荒	1,400	18,662.00	0.01
151	605296	神农集团	800	17,136.00	0.01
152	603758	秦安股份	1,600	17,024.00	0.01
153	603898	好莱客	1,700	16,524.00	0.01
154	688711	宏微科技	274	15,985.16	0.01
155	603508	思维列控	900	15,345.00	0.01
156	600662	外服控股	2,500	14,300.00	0.01
157	688041	海光信息	200	13,654.00	0.01
158	603162	海通发展	774	13,196.70	0.01
159	301293	三博脑科	177	12,641.34	0.01
160	688472	阿特斯	717	12,217.68	0.01
161	688361	中科飞测	173	11,187.91	0.01
162	688469	中芯集成	2,036	11,014.76	0.01
163	301317	鑫磊股份	417	10,912.89	0.01
164	301320	豪江智能	501	10,330.62	0.01
165	301325	曼恩斯特	91	9,823.45	0.01
166	301358	湖南裕能	229	9,821.81	0.01
167	600998	九州通	894	9,279.72	0.01
168	002056	横店东磁	500	9,105.00	0.01
169	600502	安徽建工	1,700	8,976.00	0.01
170	688629	华丰科技	476	8,848.84	0.01
171	605088	冠盛股份	500	8,575.00	0.00

172	688478	晶升股份	201	8,516.37	0.00
173	301260	格力博	352	8,317.76	0.00
174	301315	威士顿	155	7,923.60	0.00
175	688562	航天软件	346	7,719.26	0.00
176	688576	西山科技	63	7,585.83	0.00
177	688582	芯动联科	178	7,241.04	0.00
178	301382	蜂助手	219	7,191.96	0.00
179	688168	安博通	200	7,120.00	0.00
180	688146	中船特气	171	6,520.23	0.00
181	688458	美芯晟	71	6,443.96	0.00
182	688620	安凯微	519	6,404.46	0.00
183	301295	美硕科技	176	6,348.32	0.00
184	688352	颀中科技	516	6,228.12	0.00
185	600779	水井坊	100	5,899.00	0.00
186	688334	西高院	352	5,705.92	0.00
187	688543	国科军工	106	5,623.30	0.00
188	688512	慧智微	285	5,460.60	0.00
189	688535	华海诚科	105	5,379.15	0.00
190	688570	天玛智控	212	5,369.96	0.00
191	301355	南王科技	316	5,293.00	0.00
192	000922	佳电股份	400	5,264.00	0.00
193	688429	时创能源	203	5,182.59	0.00
194	301357	北方长龙	105	5,080.95	0.00
195	688433	华曙高科	161	5,071.50	0.00
196	301373	凌玮科技	159	5,064.15	0.00
197	001287	中电港	237	4,981.74	0.00
198	301428	世纪恒通	155	4,743.00	0.00
199	600850	电科数字	200	4,718.00	0.00
200	301376	致欧科技	203	4,569.53	0.00
201	301337	亚华电子	145	4,403.65	0.00
202	301439	泓淋电力	257	4,343.30	0.00
203	301322	绿通科技	81	4,312.44	0.00
204	301157	华塑科技	81	4,287.33	0.00
205	601061	中信金属	558	4,229.64	0.00
206	601168	西部矿业	400	4,204.00	0.00
207	688631	莱斯信息	140	4,181.80	0.00
208	301323	新莱福	106	4,172.16	0.00
209	000851	高鸿股份	700	3,808.00	0.00
210	688479	友车科技	122	3,597.78	0.00
211	000012	南玻 A	600	3,576.00	0.00
212	300738	奥飞数据	340	3,468.00	0.00
213	600985	淮北矿业	300	3,456.00	0.00
214	600546	山煤国际	200	2,894.00	0.00

215	000921	海信家电	100	2,695.00	0.00
216	002603	以岭药业	100	2,569.00	0.00
217	002508	老板电器	100	2,529.00	0.00
218	605338	巴比食品	100	2,525.00	0.00
219	300339	润和软件	100	2,396.00	0.00
220	601133	柏诚股份	185	2,268.10	0.00
221	601065	江盐集团	190	2,249.60	0.00
222	002030	达安基因	200	1,994.00	0.00
223	001328	登康口腔	78	1,988.22	0.00
224	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
225	001324	长青科技	95	1,862.00	0.00
226	600873	梅花生物	200	1,786.00	0.00
227	603125	常青科技	61	1,496.33	0.00
228	001360	南矿集团	98	1,457.26	0.00
229	603866	桃李面包	140	1,416.80	0.00
230	001367	海森药业	34	1,342.32	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	5,668,899.12	3.36
2	600039	四川路桥	5,277,080.00	3.13
3	002466	天齐锂业	4,914,397.00	2.91
4	002460	赣锋锂业	4,484,528.44	2.66
5	600919	江苏银行	4,453,008.00	2.64
6	601336	新华保险	4,287,165.00	2.54
7	002304	洋河股份	4,038,201.00	2.39
8	600803	新奥股份	3,984,942.00	2.36
9	300274	阳光电源	3,786,485.00	2.25
10	002756	永兴材料	3,754,441.00	2.23
11	601169	北京银行	3,737,401.00	2.22
12	000333	美的集团	3,660,436.94	2.17
13	688599	天合光能	3,621,082.85	2.15
14	600519	贵州茅台	3,580,675.00	2.12
15	601009	南京银行	3,408,566.00	2.02
16	600233	圆通速递	3,402,939.00	2.02
17	601838	成都银行	3,400,296.00	2.02
18	002129	TCL 中环	3,358,367.84	1.99
19	601166	兴业银行	3,223,015.00	1.91
20	000568	泸州老窖	3,111,245.00	1.84

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002466	天齐锂业	5,221,592.00	3.10
2	605117	德业股份	4,339,725.00	2.57
3	600919	江苏银行	4,293,561.00	2.55
4	600039	四川路桥	4,150,847.00	2.46
5	002594	比亚迪	4,131,347.00	2.45
6	600150	中国船舶	4,123,261.00	2.45
7	300014	亿纬锂能	4,006,513.00	2.38
8	600809	山西汾酒	4,000,334.00	2.37
9	000651	格力电器	3,825,795.00	2.27
10	002460	赣锋锂业	3,822,277.00	2.27
11	601336	新华保险	3,779,268.00	2.24
12	603259	药明康德	3,687,460.81	2.19
13	601668	中国建筑	3,605,725.00	2.14
14	002756	永兴材料	3,465,163.00	2.05
15	300274	阳光电源	3,424,108.04	2.03
16	002371	北方华创	3,416,407.00	2.03
17	601009	南京银行	3,365,809.00	2.00
18	601138	工业富联	3,353,889.00	1.99
19	603369	今世缘	3,197,768.54	1.90
20	688599	天合光能	3,194,263.41	1.89

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	416,809,988.59
卖出股票收入（成交）总额	411,933,127.66

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚；江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚；新华人寿保险股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会贵州监管局的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	20,410.29
2	应收清算款	152,740.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	75,083.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	248,234.49

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的情况。

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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构				
			机构投资者		个人投资者		
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	

南方沪深 300 指数增强 A	5,590	19,724.93	227,043.78	0.21%	110,035,306.22	99.79%
南方沪深 300 指数增强 C	3,452	13,148.01	-	-	45,386,938.77	100.00%
合计	9,042	17,214.03	227,043.78	0.15%	155,422,244.99	99.85%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方沪深 300 指数增强 A	486,948.04	0.4416%
	南方沪深 300 指数增强 C	20,022.26	0.0441%
	合计	506,970.30	0.3257%

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方沪深 300 指数增强 A	10~50
	南方沪深 300 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	南方沪深 300 指数增强 A	0~10
	南方沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方沪深 300 指数增强 A	南方沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日(2020 年 4 月 23 日)基金份额总额	207,317,769.06	32,901,558.76

本报告期期初基金份额总额	109,487,223.75	42,016,638.73
本报告期基金总申购份额	12,465,241.73	11,174,369.54
减：报告期基金总赎回份额	11,690,115.48	7,804,069.50
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	110,262,350.00	45,386,938.77

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣金	

	数量		票成交总 额的比例		总量的比例	
东北证券	1	169,486,611.28	20.56%	156,149.38	20.91%	-
招商证券	1	138,888,657.26	16.84%	127,954.30	17.14%	-
浙商证券	1	108,287,023.40	13.13%	99,758.49	13.36%	-
银河证券	1	99,167,423.99	12.03%	91,364.77	12.24%	-
西藏东财	1	76,676,694.85	9.30%	70,641.13	9.46%	-
安信证券	2	75,025,383.30	9.10%	69,119.17	9.26%	-
华西证券	3	53,232,761.35	6.46%	49,042.92	6.57%	-
广发证券	1	43,303,388.83	5.25%	39,896.47	5.34%	-
平安证券	1	43,174,172.10	5.24%	26,824.48	3.59%	-
海通证券	1	10,510,321.04	1.27%	9,683.37	1.30%	-
财通证券	1	3,924,398.27	0.48%	3,615.68	0.48%	-
中信建投	2	2,861,201.58	0.35%	2,636.10	0.35%	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海	1	-	-	-	-	-
金圆统一 证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

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

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

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

平安证券

退租交易单元：

无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东北证券	2,701.74	7.93%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	31,366.71	92.07%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
金圆统一证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-16
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-01
3	南方基金管理股份有限公司关于凤凰金信（海口）基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-13
4	南方基金管理股份有限公司关于凤凰金信（海口）基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-16
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-22
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
7	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-15
8	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-29
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-10
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-03
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21
13	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金参与浙商银行股份有限公司配股的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-28

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方沪深 300 指数增强型证券投资基金的文件；
- 2、《南方沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方沪深 300 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>