

南方沪深 300 交易型开放式指数证券 投资基金 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 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.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	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.....	11
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）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	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.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	50

7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12	投资组合报告附注	51
§8	基金份额持有人信息	52
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2	期末上市基金前十名持有人	52
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
§9	开放式基金份额变动	53
§10	重大事件揭示	54
10.1	基金份额持有人大会决议	54
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4	基金投资策略的改变	54
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8	其他重大事件	56
§11	影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	59
§12	备查文件目录	59
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	59
12.3	查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方沪深 300ETF
场内简称	沪深 300ETF 南方
基金主代码	159925
交易代码	159925
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 18 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,116,320,856.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 4 月 11 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用指数复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数：沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95588

传真	0755-82763889	010-66105798
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518017	100140
法定代表人	周易	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-106,729,732.08
本期利润	-4,455,528.84
加权平均基金份额本期利润	-0.0041
本期加权平均净值利润率	-0.13%
本期基金份额净值增长率	1.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,374,504,226.61
期末可供分配基金份额利润	1.2312
期末基金资产净值	3,903,106,086.52
期末基金份额净值	3.4964
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	66.53%

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。

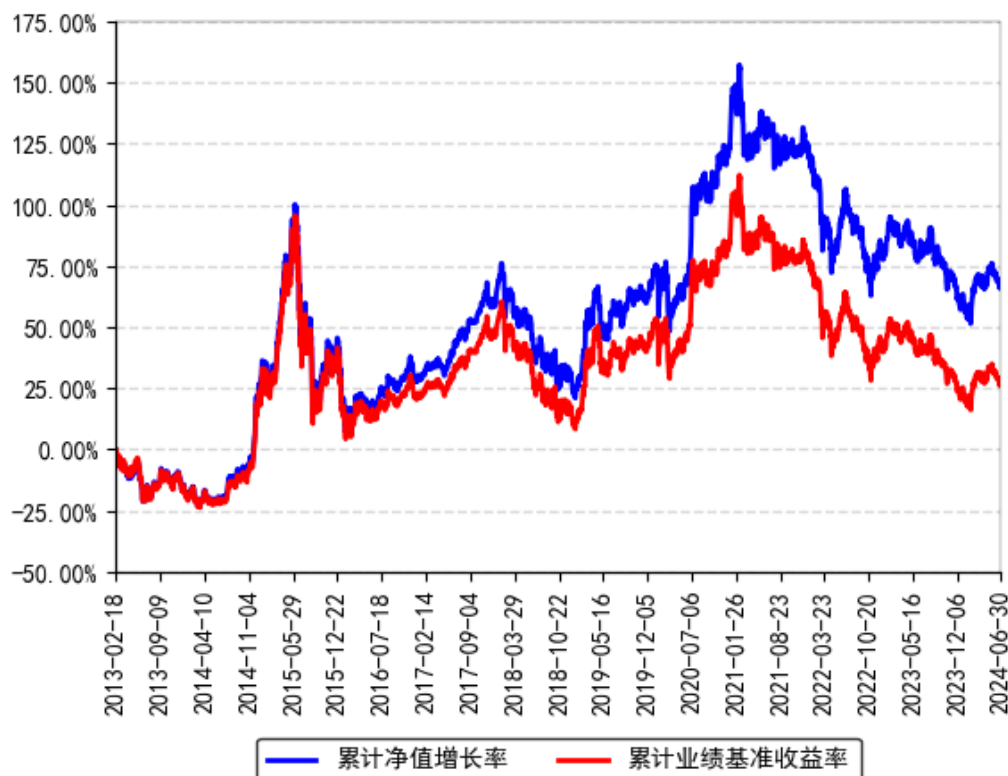
3.2 基金净值表现

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

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	-2.55%	0.48%	-3.30%	0.48%	0.75%	0.00%
过去三个月	-1.08%	0.75%	-2.14%	0.76%	1.06%	-0.01%
过去六个月	1.86%	0.90%	0.89%	0.90%	0.97%	0.00%
过去一年	-7.88%	0.87%	-9.91%	0.87%	2.03%	0.00%
过去三年	-28.97%	1.05%	-33.74%	1.05%	4.77%	0.00%
自基金合同生效起至今	66.53%	1.36%	26.45%	1.37%	40.08%	-0.01%

3.2.2 自基金转型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300ETF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。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（助理）期限	证券从业	说明

		任职日期	离任日期	年限	
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 5 月 17 日	-	19 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2021 年 3 月 12 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 10 月 22 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证全指医疗保健 ETF 基金经理；2020 年 12 月 25 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方策略基金经理；2021 年 7 月 2 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方中证香港科技 ETF (QDII) 基金经理；2022 年 6 月 17 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方恒生香港上市生物科技 ETF (QDII) 基金经理；2013 年 4 月 22 日至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 17 日至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月 21 日至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月 24 日至今，任南方房地产联接基金经理；2017 年 8 月 25 日至今，任南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 4 月 3 日至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月 8 日至今，任 MSCI 联接基金经理；2020 年 7 月 24 日至今，兼任投资经理；2023 年 5 月 30 日至今，任南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接(QDII) 基金经理；2024 年 6 月 26 日至今，任南方中证国新港股通央企红利 ETF 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。

4.1.3 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	12	94,898,159,790.48	2013年04月22日
	私募资产管理计划	8	2,644,004,064.49	2020年08月07日
	其他组合	-	-	-
	合计	20	97,542,163,854.97	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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69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

报告期内，沪深 300 指数涨 0.89%。

期间我们通过自建的指数化交易系统、日内择时交易模型、跟踪误差归因分析系统、ETF 现金流精算系统等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- (1) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- (2) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；
- (3) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 3.4964 元，报告期内，份额净值增长率为 1.86%，同期业绩基准增长率为 0.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2 月，指数触底，并开启反弹进程。一季报披露结束后，剔除后地产及地产链、新能源等行业有非金融板块 24Q1 净利润增速转正，也是相同口径成分股净利润自 2022 年三季度以来首次转正。二季度开始，随着专项债项目和超长期特别国债项目加速释放，政府新项目投资明显改善。目前外需改善的趋势仍在，去年二三季度基数相对比较低，经济增速有望进一步反弹。目前的消费增速也相对稳定。价格变量有望触底反弹。4 月政治局会议定调“坚持乘势而上，避免前紧后松，切实巩固和增强经济回升向好态势”、“避免前紧后松”的表述释放了明确的政策信号，有利于缓解此前市场对于宏观政策持续性的担忧。作为 A 股核心宽基指数的代表，沪深 300 指数市盈率及市净率现下位列全球主要市场末端，未来估值修复空间较大。

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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	11,676,331.09	61,828,688.59
结算备付金		4,903,982.93	1,414,538.50
存出保证金		3,220,407.40	543,303.73
交易性金融资产	6.4.3.2	3,887,907,642.04	3,119,249,952.06
其中：股票投资		3,887,906,641.97	3,119,249,952.06
基金投资		-	-
债券投资		1,000.07	-
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		674,814.74	7,639,109.24
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	71,145.54
资产总计		3,908,383,178.20	3,190,746,737.66
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		-	330,466.42
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		485,556.79	777,594.64
应付托管费		161,852.26	155,518.94
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8.00	6,908.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	4,629,674.63	65,866,697.20
负债合计		5,277,091.68	67,137,186.18
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	2,528,601,859.91	2,061,304,033.83
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	1,374,504,226.61	1,062,305,517.65
净资产合计		3,903,106,086.52	3,123,609,551.48
负债和净资产总计		3,908,383,178.20	3,190,746,737.66

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.4964 元，基金份额总额 1,116,320,856.00 份。

6.2 利润表

会计主体：南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,000,910.13	17,290,985.41
1.利息收入		448,892.03	1,081,936.19
其中：存款利息收入	6.4.3.9	86,440.24	10,505.74
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		-	-
其他利息收入		362,451.79	1,071,430.45
2.投资收益（损失以“-”		-104,881,898.82	5,141,952.68

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-150,878,241.49	-14,152,879.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	57.66	74,721.59
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	629,032.04	-165,178.32
股利收益	6.4.3.13	45,367,252.97	19,385,289.09
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）	6.4.3.14	102,274,203.24	11,131,977.98
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	4,159,713.68	-64,881.44
减：二、营业总支出		6,456,438.97	5,316,406.57
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	4,642,056.31	4,132,892.69
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.6.2.2	1,138,244.26	826,578.58
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		4,467.54	4,481.34
8.其他费用	6.4.3.16	671,670.86	352,453.96
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-4,455,528.84	11,974,578.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-4,455,528.84	11,974,578.84
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-4,455,528.84	11,974,578.84

6.3 净资产变动表

会计主体：南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	2,061,304,033.83	-	1,062,305,517.65	3,123,609,551.48
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,061,304,033.83	-	1,062,305,517.65	3,123,609,551.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	467,297,826.08	-	312,198,708.96	779,496,535.04
（一）、综合收益总额	-	-	-4,455,528.84	-4,455,528.84
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	467,297,826.08	-	316,654,237.80	783,952,063.88
其中：1.基金申购款	2,002,344,830.71	-	1,114,940,100.82	3,117,284,931.53
2.基金赎回款	-1,535,047,004.63	-	-798,285,863.02	-2,333,332,867.65
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,528,601,859.91	-	1,374,504,226.61	3,903,106,086.52
项目	上年度可比期间 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	995,977,256.20	-	664,556,344.85	1,660,533,601.05
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	995,977,256.20	-	664,556,344.85	1,660,533,601.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-43,343,059.45	-	-20,998,453.11	-64,341,512.56
(一)、综合收益总额	-	-	11,974,578.84	11,974,578.84
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-43,343,059.45	-	-32,973,031.95	-76,316,091.40
其中：1.基金申购款	27,374,563.90	-	19,201,500.29	46,576,064.19
2.基金赎回款	-70,717,623.35	-	-52,174,532.24	-122,892,155.59
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	952,634,196.75	-	643,557,891.74	1,596,192,088.49

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____ ____常克川____ ____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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	11,676,331.09
等于：本金	11,675,159.44
加：应计利息	1,171.65
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	11,676,331.09

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	4,027,016,336.16	-	3,887,906,641.97	-139,109,694.19	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,000.00	0.07	1,000.07	-
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	1,000.00	0.07	1,000.07	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,027,017,336.16	0.07	3,887,907,642.04	-139,109,694.19

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	14,682,136.00	-	-	-
—股指期货	14,682,136.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	14,682,136.00	-	-	-

6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2407	IF2407	14.00	14,435,400.00	-246,736.00
合计				-246,736.00
减：可抵销期货暂收款				-246,736.00
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	137,336.96
其中：交易所市场	137,336.96
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	3,291,030.35
预提费用	154,426.14
应付指数使用费	296,881.18
可退替代款	-
合计	4,629,674.63

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,807,199,451.00	2,061,304,033.83
本期申购	138,000,000.00	157,403,742.30
本期赎回（以“-”号填列）	-588,000,000.00	-670,676,815.05
2024 年 1 月 26 日基金拆分/份额折算前	1,357,199,451.00	1,548,030,961.08
基金拆分/份额折算调整	-673,778,595.00	-
本期申购	814,500,000.00	1,844,941,088.41
本期赎回（以“-”号填列）	-381,600,000.00	-864,370,189.58
本期末	1,116,320,856.00	2,528,601,859.91

注：1. 红利再投及转入份额计入本期申购，转出份额计入本期赎回。

2. 根据《南方基金管理股份有限公司关于南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额合并结果的公告》的有关规定，本基金的基金管理人确定 2024 年 1 月 26 日为本基金的基金份额合并日。本基金合并前，基金份额总额为 1,357,199,451.00 份，基金份额净值为 1.6786 元；本基金合并后，基金份额总额为 683,420,856.00 份，基金份额净值为 3.3335 元。本基金管理人已按照上述合并比例对权益登记日登记在册的各基金份额持有人的基金份额进行了合并，并由中国证券登记结算有限责任公司进行了变更登记。

6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,821,499,691.34	-1,759,194,173.69	1,062,305,517.65

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,821,499,691.34	-1,759,194,173.69	1,062,305,517.65
本期利润	-106,729,732.08	102,274,203.24	-4,455,528.84
本期基金份额交易产生的变动数	572,587,771.74	-255,933,533.94	316,654,237.80
其中：基金申购款	2,585,324,825.51	-1,470,384,724.69	1,114,940,100.82
基金赎回款	-2,012,737,053.77	1,214,451,190.75	-798,285,863.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,287,357,731.00	-1,912,853,504.39	1,374,504,226.61

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	21,623.37
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	57,050.60
其他	7,766.27
合计	86,440.24

6.4.3.10 股票投资收益

6.4.3.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-62,539,471.48
股票投资收益——赎回差价收入	-88,338,770.01
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	-150,878,241.49

6.4.3.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,754,178,720.08
减：卖出股票成本总额	1,815,220,653.33
减：交易费用	1,497,538.23
买卖股票差价收入	-62,539,471.48

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	2,333,332,867.65
减：现金支付赎回款总额	1,485,043,581.65
减：赎回股票成本总额	936,628,056.01
减：交易费用	-
赎回差价收入	-88,338,770.01

6.4.3.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	0.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	57.45
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	57.66

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,057.63
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,000.00
减：应计利息总额	0.14
减：交易费用	0.04
买卖债券差价收入	57.45

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

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	629,032.04

6.4.3.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	45,367,252.97
其中：证券出借权益补偿收入	3,225.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	45,367,252.97

6.4.3.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	102,593,619.24
——股票投资	102,593,619.24
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-319,416.00
——权证投资	-
——期货投资	-319,416.00
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	102,274,203.24

6.4.3.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	4,130,462.22
其他	29,251.46
合计	4,159,713.68

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额，或强制退款的被替代证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	498,848.06
银行费用	396.66
其他	18,000.00
律师费	50,000.00
合计	671,670.86

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2024 年 8 月 8 日宣告 2024 年度第 1 次分红，向截至 2024 年 8 月 12 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.7400 元。

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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
华泰长城资本管理有限公司("华泰长城")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金("南方沪深 300ETF 联接基金")	本基金的基金管理人管理的其他基金

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	260,543,824.64	6.89%	137,709,623.98	53.55%

6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	-	-	453,942.02	100.00%

6.4.6.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	26,055.18	6.89%	2,494.33	1.82%
关联方名称	上年度可比期间 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	13,772.20	53.55%	11,933.54	79.37%

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符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告〔2024〕3号）相关规定。《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》生效后，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024	上年度可比期间 2023 年 1 月
----	-------------------------	--------------------

	年 6 月 30 日	1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,642,056.31	4,132,892.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	35,265.67	-
应支付基金管理人的净管理费	4,606,790.64	4,132,892.69

注：于 2024 年 3 月 26 日前，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 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% \div \text{当年天数}。$$

根据《南方基金管理股份有限公司关于调低南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金费率并修订基金合同的公告》，自 2024 年 3 月 26 日起，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 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,138,244.26	826,578.58

注：于 2024 年 3 月 26 日前，支付基金托管人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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}。$$

根据《南方基金管理股份有限公司关于调低南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金费率并修订基金合同的公告》，自 2024 年 3 月 26 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.3 销售服务费

无。

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

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	-	-	-	-

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	139,845,176.00	165,318.42	-	-

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

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	44,260,668.00	2~3.5	3.15	68,082.04	-	-

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	120,580,944.00	2~3.5	3.30	164,305.62	17,837,388.00	7,515.31

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自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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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
华泰长城资本管理有限公司	-	-	11,600,900.00	0.64%
华泰证券股份有限公司	52,527,764.00	4.71%	89,993,654.00	4.98%
兴业证券股份有限公司	3,196,927.00	0.29%	-	-

中国工商银行—南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	392,686,074.00	35.18%	744,927,719.00	41.22%
--------------------------------------	----------------	--------	----------------	--------

注：本基金其他关联方投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	11,676,331.09	21,623.37	4,054,105.27	4,000.99

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	688709	成都华微	网下申购	10,448	163,929.12
华泰联合	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
华泰联合	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88
兴业证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80

上年度可比期间 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	62,602	694,882.20
华泰联合	118031	天 23 转债	配债	2,940	294,000.00
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
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	2,604	341,410.44
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	2,253	72,749.37
兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	网下申购	137,994	785,185.86

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

于本期末，本基金持有关联方兴业证券、华泰证券、中国工商银行发行的普通股，成本总额为人民币 64,437,249.28 元，估值总额为人民币 65,212,713.32 元，占本基金基金资产净值的比例为 1.67% (于上期末，本基金持有关联方兴业证券、华泰证券、中国工商银行发行的普通股，成本总额为人民币 52,640,494.17 元，估值总额为人民币 50,377,560.64 元，占本基金基金资产净值的比例为 1.61%)。

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。本基金的基金管理人于 2024 年 8 月 8 日宣告 2024 年度第 1 次分红，向截至 2024 年 8 月 12 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.7400 元。

6.4.8 期末（2024 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
301589	诺瓦星云	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-
301589	诺瓦星云	2024 年 5 月 30 日	1-6 个月（含）	锁定期转增	-	188.01	553	-	103,969.53	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定期	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内（含）	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股锁定期	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
301536	星宸科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股锁定期	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-

688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024 年 5 月 22 日	1-6 个 月(含)	锁定期 转增	-	91.24	43	-	3,923.32	-
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股锁 定期	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股锁 定期	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股锁 定期	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29	6 个月	新股锁 定期	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-

		日								
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股锁 定期	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股锁 定期	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股锁 定期	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-

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
113685	升 24 转债	2024 年 6 月 19 日	1 个月 内(含)	新债未 上市	100.0 0	100.0 1	10	1,000.00	1,000.07	-

注：本基金持有的上述流通受限证券，根据中国证监会、证券交易所发布的相关规定，在受限期内不得转让：

1. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2. 基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3. 基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4. 基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金是指数型基金，紧密跟踪沪深 300 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪沪深 300 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，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净资产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。本基金为履行与金融负债有关的义务而调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，可能产生基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行期货投资，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过多头

或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不付息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在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，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超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合该要求。

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

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。

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,676,331.09	-	-	-	11,676,331.09
结算备付金	4,903,982.93	-	-	-	4,903,982.93
存出保证金	1,488,159.40	-	-	1,732,248.00	3,220,407.40
交易性金融资产	-	-	1,000.07	3,887,906.64 1.97	3,887,907.64 2.04
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	-	-	-	674,814.74	674,814.74
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	18,068,473.4 2	-	1,000.07	3,890,313.70 4.71	3,908,383.17 8.20
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	-	-	-	-	-
应付管理人	-	-	-	485,556.79	485,556.79

报酬					
应付托管费	-	-	-	161,852.26	161,852.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	8.00	8.00
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	4,629,674.63	4,629,674.63
负债总计	-	-	-	5,277,091.68	5,277,091.68
利率敏感度缺口	18,068,473.42	-	1,000.07	3,885,036.613.03	3,903,106.086.52
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	61,828,688.59	-	-	-	61,828,688.59
结算备付金	1,414,538.50	-	-	-	1,414,538.50
存出保证金	171,805.33	-	-	371,498.40	543,303.73
交易性金融资产	-	-	-	3,119,249,952.06	3,119,249,952.06
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	-	-	-	7,639,109.24	7,639,109.24
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	71,145.54	71,145.54
资产总计	63,415,032.42	-	-	3,127,331,705.24	3,190,746,737.66
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	-	-	-	330,466.42	330,466.42
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	777,594.64	777,594.64
应付托管费	-	-	-	155,518.94	155,518.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6,908.98	6,908.98
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	65,866,697.20	65,866,697.20
负债总计	-	-	-	67,137,186.18	67,137,186.18
利率敏感度缺口	63,415,032.42	-	-	3,060,194.519.06	3,123,609.551.48

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（2024年6月30日）	上年度末（2023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交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪沪深 300 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，沪深 300 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	3,887,906,641.97	99.61	3,119,249,952.06	99.86
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	3,887,906,641.97	99.61	3,119,249,952.06	99.86

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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(2024年6月30日)	上年度末(2023年12月31日)
	1.组合自身基准上升 5%	194,130,381.13	155,382,881.75
	2.组合自身基准下降 5%	-194,130,381.13	-155,382,881.75

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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	3,887,388,095.52
第二层次	46,611.18
第三层次	472,935.34
合计	3,887,907,642.04

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，确定相关金融工具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

于本期末，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。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 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	3,887,906,641.97	99.48
	其中：股票	3,887,906,641.97	99.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,000.07	0.00
	其中：债券	1,000.07	0.00
	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	16,580,314.02	0.42
8	其他各项资产	3,895,222.14	0.10
9	合计	3,908,383,178.20	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而行业分类的合计项中不含可退替代款估值增值。

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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	49,141,921.60	1.26
B	采矿业	236,756,554.51	6.07
C	制造业	2,024,834,305.43	51.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	182,321,921.82	4.67
E	建筑业	86,965,607.23	2.23
F	批发和零售业	10,052,140.68	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	145,809,905.64	3.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	175,785,372.56	4.50
J	金融业	867,422,779.99	22.22
K	房地产业	35,774,415.29	0.92
L	租赁和商务服务业	31,178,815.84	0.80
M	科学研究和技术服务业	30,827,377.09	0.79
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	10,516,977.84	0.27
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,887,388,095.52	99.60

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	471,565.43	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,981.02	0.00
J	金融业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	518,546.45	0.01

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

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	600519	贵州茅台	137,491	201,752,918.49	5.17
2	300750	宁德时代	577,280	103,927,718.40	2.66

3	601318	中国平安	2,354,452	97,380,134.72	2.49
4	600036	招商银行	2,707,542	92,570,860.98	2.37
5	600900	长江电力	2,676,003	77,390,006.76	1.98
6	000333	美的集团	1,067,824	68,874,648.00	1.76
7	601899	紫金矿业	3,603,387	63,311,509.59	1.62
8	601166	兴业银行	3,180,985	56,048,955.70	1.44
9	000858	五粮液	424,878	54,401,379.12	1.39
10	002594	比亚迪	198,411	49,652,352.75	1.27
11	601328	交通银行	6,010,234	44,896,447.98	1.15
12	601398	工商银行	7,667,400	43,704,180.00	1.12
13	002475	立讯精密	1,099,060	43,204,048.60	1.11
14	600030	中信证券	2,135,409	38,928,506.07	1.00
15	000651	格力电器	985,564	38,653,820.08	0.99
16	300760	迈瑞医疗	132,700	38,603,757.00	0.99
17	600276	恒瑞医药	976,792	37,567,420.32	0.96
18	600887	伊利股份	1,392,836	35,990,882.24	0.92
19	600309	万华化学	412,393	33,346,097.98	0.85
20	000725	京东方 A	8,084,782	33,066,758.38	0.85
21	601088	中国神华	721,430	32,009,849.10	0.82
22	601288	农业银行	6,983,374	30,447,510.64	0.78
23	300059	东方财富	2,762,883	29,176,044.48	0.75
24	601816	京沪高铁	5,401,500	29,006,055.00	0.74
25	300308	中际旭创	196,373	27,075,909.24	0.69
26	002714	牧原股份	597,687	26,059,153.20	0.67
27	601857	中国石油	2,478,443	25,577,531.76	0.66
28	002415	海康威视	816,159	25,227,474.69	0.65
29	601668	中国建筑	4,552,462	24,173,573.22	0.62
30	600919	江苏银行	3,211,620	23,862,336.60	0.61
31	601138	工业富联	869,100	23,813,340.00	0.61
32	600690	海尔智家	828,006	23,498,810.28	0.60
33	000568	泸州老窖	161,134	23,121,117.66	0.59
34	300498	温氏股份	1,164,620	23,082,768.40	0.59
35	600809	山西汾酒	106,680	22,496,678.40	0.58
36	002371	北方华创	69,564	22,252,827.96	0.57
37	601985	中国核电	2,065,200	22,015,032.00	0.56
38	601225	陕西煤业	852,010	21,956,297.70	0.56
39	600406	国电南瑞	878,700	21,932,352.00	0.56
40	603259	药明康德	552,161	21,639,189.59	0.55
41	601919	中远海控	1,396,020	21,624,349.80	0.55
42	000001	平安银行	2,122,711	21,545,516.65	0.55
43	600031	三一重工	1,299,031	21,434,011.50	0.55
44	601988	中国银行	4,610,955	21,302,612.10	0.55
45	600941	中国移动	197,600	21,242,000.00	0.54

46	600000	浦发银行	2,568,419	21,138,088.37	0.54
47	300124	汇川技术	410,314	21,049,108.20	0.54
48	601728	中国电信	3,396,400	20,887,860.00	0.54
49	601601	中国太保	748,764	20,860,565.04	0.53
50	000792	盐湖股份	1,188,400	20,737,580.00	0.53
51	600028	中国石化	3,194,857	20,191,496.24	0.52
52	601766	中国中车	2,660,868	19,983,118.68	0.51
53	600150	中国船舶	489,200	19,915,332.00	0.51
54	688981	中芯国际	431,605	19,896,990.50	0.51
55	300274	阳光电源	317,160	19,673,434.80	0.50
56	600050	中国联通	4,174,089	19,618,218.30	0.50
57	000063	中兴通讯	697,175	19,499,984.75	0.50
58	000338	潍柴动力	1,192,260	19,362,302.40	0.50
59	002352	顺丰控股	535,800	19,122,702.00	0.49
60	601169	北京银行	3,237,849	18,909,038.16	0.48
61	601012	隆基绿能	1,326,183	18,593,085.66	0.48
62	603501	韦尔股份	186,490	18,531,511.30	0.47
63	600837	海通证券	2,112,100	18,079,576.00	0.46
64	000100	TCL 科技	4,108,329	17,747,981.28	0.45
65	600016	民生银行	4,654,624	17,641,024.96	0.45
66	002230	科大讯飞	404,657	17,380,018.15	0.45
67	600660	福耀玻璃	350,469	16,787,465.10	0.43
68	002142	宁波银行	722,305	15,934,048.30	0.41
69	601229	上海银行	2,175,214	15,792,053.64	0.40
70	600089	特变电工	1,105,395	15,331,828.65	0.39
71	600938	中国海油	457,804	15,107,532.00	0.39
72	601390	中国中铁	2,247,092	14,651,039.84	0.38
73	000625	长安汽车	1,086,207	14,587,760.01	0.37
74	688041	海光信息	203,339	14,298,798.48	0.37
75	600104	上汽集团	1,012,941	14,039,362.26	0.36
76	603986	兆易创新	145,908	13,951,722.96	0.36
77	601688	华泰证券	1,119,500	13,870,605.00	0.36
78	600436	片仔癀	66,800	13,838,956.00	0.35
79	600048	保利发展	1,571,109	13,762,914.84	0.35
80	601006	大秦铁路	1,921,306	13,756,550.96	0.35
81	600905	三峡能源	3,130,800	13,650,288.00	0.35
82	688012	中微公司	95,530	13,494,567.80	0.35
83	601211	国泰君安	990,300	13,418,565.00	0.34
84	002027	分众传媒	2,211,540	13,401,932.40	0.34
85	601888	中国中免	213,256	13,326,367.44	0.34
86	603019	中科曙光	319,756	13,269,874.00	0.34
87	601600	中国铝业	1,734,498	13,234,219.74	0.34
88	603993	洛阳钼业	1,545,730	13,138,705.00	0.34

89	601818	光大银行	4,060,885	12,873,005.45	0.33
90	600019	宝钢股份	1,935,485	12,870,975.25	0.33
91	603288	海天味业	364,960	12,580,171.20	0.32
92	600585	海螺水泥	525,053	12,386,000.27	0.32
93	601658	邮储银行	2,428,800	12,314,016.00	0.32
94	601989	中国重工	2,494,235	12,296,578.55	0.32
95	600886	国投电力	651,639	11,885,895.36	0.30
96	601009	南京银行	1,131,461	11,755,879.79	0.30
97	600795	国电电力	1,950,830	11,685,471.70	0.30
98	688111	金山办公	50,940	11,588,850.00	0.30
99	688008	澜起科技	200,824	11,479,099.84	0.29
100	601628	中国人寿	364,453	11,316,265.65	0.29
101	600999	招商证券	811,672	11,290,357.52	0.29
102	600438	通威股份	590,700	11,288,277.00	0.29
103	000938	紫光股份	500,567	11,187,672.45	0.29
104	000425	徐工机械	1,550,885	11,088,827.75	0.28
105	601939	建设银行	1,471,224	10,887,057.60	0.28
106	600547	山东黄金	395,024	10,815,757.12	0.28
107	300014	亿纬锂能	268,300	10,710,536.00	0.27
108	600893	航发动力	291,341	10,648,513.55	0.27
109	002304	洋河股份	131,873	10,647,426.02	0.27
110	002179	中航光电	278,127	10,582,732.35	0.27
111	601669	中国电建	1,882,042	10,520,614.78	0.27
112	300015	爱尔眼科	1,019,087	10,516,977.84	0.27
113	000002	万科 A	1,489,113	10,319,553.09	0.26
114	002241	歌尔股份	522,764	10,199,125.64	0.26
115	600926	杭州银行	777,700	10,148,985.00	0.26
116	000538	云南白药	195,284	9,988,776.60	0.26
117	600584	长电科技	312,590	9,912,228.90	0.25
118	600760	中航沈飞	241,077	9,667,187.70	0.25
119	600111	北方稀土	553,394	9,518,376.80	0.24
120	600489	中金黄金	635,600	9,406,880.00	0.24
121	002050	三花智控	489,311	9,336,053.88	0.24
122	600011	华能国际	962,300	9,257,326.00	0.24
123	688256	寒武纪	45,911	9,121,138.37	0.23
124	601916	浙商银行	3,297,300	9,100,548.00	0.23
125	002252	上海莱士	1,163,380	9,097,631.60	0.23
126	600015	华夏银行	1,392,723	8,913,427.20	0.23
127	600009	上海机场	272,040	8,773,290.00	0.22
128	600958	东方证券	1,150,388	8,742,948.80	0.22
129	600426	华鲁恒升	325,000	8,658,000.00	0.22
130	601186	中国铁建	1,006,603	8,626,587.71	0.22
131	002311	海大集团	182,200	8,572,510.00	0.22

132	300408	三环集团	293,400	8,564,346.00	0.22
133	000166	申万宏源	1,971,991	8,499,281.21	0.22
134	000157	中联重科	1,088,643	8,360,778.24	0.21
135	601901	方正证券	1,080,441	8,351,808.93	0.21
136	600989	宝丰能源	481,300	8,340,929.00	0.21
137	000977	浪潮信息	225,036	8,184,559.32	0.21
138	600674	川投能源	426,200	7,991,250.00	0.20
139	003816	中国广核	1,721,000	7,968,230.00	0.20
140	688271	联影医疗	72,550	7,958,735.00	0.20
141	300433	蓝思科技	435,897	7,955,120.25	0.20
142	000776	广发证券	647,569	7,880,914.73	0.20
143	002049	紫光国微	148,520	7,812,152.00	0.20
144	002001	新和成	405,842	7,792,166.40	0.20
145	601377	兴业证券	1,509,472	7,637,928.32	0.20
146	688036	传音控股	99,402	7,608,229.08	0.19
147	000596	古井贡酒	35,950	7,587,966.50	0.19
148	601111	中国国航	1,018,431	7,516,020.78	0.19
149	600115	中国东航	1,872,114	7,507,177.14	0.19
150	300122	智飞生物	261,842	7,339,431.26	0.19
151	000768	中航西飞	304,089	7,307,258.67	0.19
152	002460	赣锋锂业	246,740	7,069,101.00	0.18
153	601800	中国交建	779,887	6,972,189.78	0.18
154	001979	招商蛇口	792,984	6,970,329.36	0.18
155	600029	南方航空	1,182,800	6,966,692.00	0.18
156	600010	包钢股份	4,964,686	6,950,560.40	0.18
157	601633	长城汽车	272,305	6,889,316.50	0.18
158	600188	兖矿能源	301,200	6,846,276.00	0.18
159	002601	龙佰集团	365,400	6,785,478.00	0.17
160	002466	天齐锂业	226,100	6,762,651.00	0.17
161	002236	大华股份	431,763	6,675,055.98	0.17
162	601117	中国化学	805,500	6,637,320.00	0.17
163	002648	卫星化学	368,420	6,624,191.60	0.17
164	000786	北新建材	221,700	6,575,622.00	0.17
165	603799	华友钴业	297,116	6,575,177.08	0.17
166	000661	长春高新	71,394	6,551,827.38	0.17
167	600346	恒力石化	461,860	6,442,947.00	0.17
168	002493	荣盛石化	665,400	6,427,764.00	0.16
169	000983	山西焦煤	621,000	6,402,510.00	0.16
170	300782	卓胜微	82,220	6,391,782.80	0.16
171	603369	今世缘	137,400	6,347,880.00	0.16
172	600372	中航机载	529,400	6,336,918.00	0.16
173	600161	天坛生物	259,260	6,325,944.00	0.16
174	601838	成都银行	416,400	6,325,116.00	0.16

175	600023	浙能电力	880,000	6,256,800.00	0.16
176	601788	光大证券	427,300	6,247,126.00	0.16
177	688223	晶科能源	875,541	6,216,341.10	0.16
178	600196	复星医药	278,380	6,163,333.20	0.16
179	002129	TCL 中环	710,650	6,147,122.50	0.16
180	300418	昆仑万维	190,400	6,138,496.00	0.16
181	000807	云铝股份	454,300	6,137,593.00	0.16
182	600845	宝信软件	190,508	6,082,920.44	0.16
183	601872	招商轮船	716,300	6,052,735.00	0.16
184	002938	鹏鼎控股	152,200	6,051,472.00	0.16
185	601868	中国能建	2,849,800	6,041,576.00	0.15
186	601021	春秋航空	106,900	6,021,677.00	0.15
187	601360	三六零	781,700	6,003,456.00	0.15
188	300661	圣邦股份	71,965	5,957,262.70	0.15
189	600233	圆通速递	376,900	5,898,485.00	0.15
190	600219	南山铝业	1,537,000	5,855,970.00	0.15
191	600570	恒生电子	330,860	5,842,987.60	0.15
192	600176	中国巨石	525,511	5,806,896.55	0.15
193	600085	同仁堂	150,288	5,742,504.48	0.15
194	601995	中金公司	193,700	5,735,457.00	0.15
195	002180	纳思达	216,500	5,719,930.00	0.15
196	300896	爱美客	33,220	5,717,162.00	0.15
197	605499	东鹏饮料	26,400	5,695,800.00	0.15
198	600600	青岛啤酒	78,137	5,686,029.49	0.15
199	600741	华域汽车	346,304	5,672,459.52	0.15
200	603392	万泰生物	83,837	5,523,181.56	0.14
201	300347	泰格医药	113,600	5,520,960.00	0.14
202	601100	恒立液压	118,372	5,513,767.76	0.14
203	601336	新华保险	182,917	5,492,997.51	0.14
204	002736	国信证券	630,901	5,482,529.69	0.14
205	601066	中信建投	284,300	5,469,932.00	0.14
206	002271	东方雨虹	442,500	5,460,450.00	0.14
207	601689	拓普集团	101,700	5,452,137.00	0.14
208	600183	生益科技	258,700	5,448,222.00	0.14
209	000895	双汇发展	228,695	5,436,080.15	0.14
210	600362	江西铜业	228,295	5,406,025.60	0.14
211	600745	闻泰科技	190,600	5,384,450.00	0.14
212	002920	德赛西威	61,700	5,373,453.00	0.14
213	000963	华东医药	192,828	5,362,546.68	0.14
214	001965	招商公路	446,600	5,296,676.00	0.14
215	600027	华电国际	744,700	5,168,218.00	0.13
216	601881	中国银河	475,300	5,161,758.00	0.13
217	601898	中煤能源	401,700	5,013,216.00	0.13

218	688126	沪硅产业	360,567	4,979,430.27	0.13
219	300033	同花顺	47,300	4,905,010.00	0.13
220	002459	晶澳科技	433,720	4,857,664.00	0.12
221	601618	中国中冶	1,562,067	4,842,407.70	0.12
222	002916	深南电路	45,154	4,775,938.58	0.12
223	000999	华润三九	112,150	4,775,347.00	0.12
224	600026	中远海能	304,100	4,747,001.00	0.12
225	601699	潞安环能	261,800	4,746,434.00	0.12
226	600515	海南机场	1,503,700	4,721,618.00	0.12
227	601607	上海医药	245,400	4,689,594.00	0.12
228	300832	新产业	69,500	4,687,080.00	0.12
229	000301	东方盛虹	576,800	4,597,096.00	0.12
230	601878	浙商证券	424,300	4,548,496.00	0.12
231	000876	新希望	497,198	4,544,389.72	0.12
232	600875	东方电气	245,100	4,522,095.00	0.12
233	600332	白云山	153,879	4,513,271.07	0.12
234	601998	中信银行	672,332	4,504,624.40	0.12
235	600039	四川路桥	570,380	4,500,298.20	0.12
236	601877	正泰电器	235,000	4,479,100.00	0.11
237	600588	用友网络	447,621	4,476,210.00	0.11
238	002074	国轩高科	232,900	4,460,035.00	0.11
239	002555	三七互娱	341,300	4,453,965.00	0.11
240	600415	小商品城	599,800	4,450,516.00	0.11
241	002709	天赐材料	253,300	4,447,948.00	0.11
242	688396	华润微	117,868	4,412,977.92	0.11
243	600025	华能水电	393,800	4,245,164.00	0.11
244	600803	新奥股份	203,300	4,228,640.00	0.11
245	000408	藏格矿业	173,000	4,164,110.00	0.11
246	300223	北京君正	74,400	4,124,736.00	0.11
247	300316	晶盛机电	143,000	4,108,390.00	0.11
248	002812	恩捷股份	128,400	4,063,860.00	0.10
249	300628	亿联网络	110,400	4,059,408.00	0.10
250	688599	天合光能	238,363	4,033,101.96	0.10
251	300142	沃森生物	351,636	4,001,617.68	0.10
252	300450	先导智能	240,200	3,994,526.00	0.10
253	605117	德业股份	52,956	3,936,749.04	0.10
254	600460	士兰微	218,200	3,820,682.00	0.10
255	002007	华兰生物	240,055	3,790,468.45	0.10
256	601238	广汽集团	484,900	3,753,126.00	0.10
257	300496	中科创达	81,000	3,692,790.00	0.09
258	301269	华大九天	47,834	3,685,609.70	0.09
259	603260	合盛硅业	78,900	3,685,419.00	0.09
260	300759	康龙化成	197,375	3,667,227.50	0.09

261	300751	迈为股份	30,680	3,665,646.40	0.09
262	000733	振华科技	87,000	3,613,110.00	0.09
263	601319	中国人保	696,700	3,588,005.00	0.09
264	300999	金龙鱼	130,500	3,569,175.00	0.09
265	600018	上港集团	609,082	3,520,493.96	0.09
266	601799	星宇股份	31,400	3,518,056.00	0.09
267	002821	凯莱英	52,640	3,463,712.00	0.09
268	600918	中泰证券	608,900	3,452,463.00	0.09
269	300413	芒果超媒	164,304	3,433,953.60	0.09
270	688009	中国通号	564,344	3,386,064.00	0.09
271	603806	福斯特	229,465	3,373,135.50	0.09
272	601865	福莱特	165,900	3,334,590.00	0.09
273	603659	璞泰来	233,290	3,296,387.70	0.08
274	603195	公牛集团	42,723	3,294,797.76	0.08
275	600132	重庆啤酒	53,300	3,235,310.00	0.08
276	600061	国投资本	565,300	3,193,945.00	0.08
277	300919	中伟股份	102,460	3,175,235.40	0.08
278	000617	中油资本	554,000	3,058,080.00	0.08
279	000708	中信特钢	223,500	3,032,895.00	0.08
280	601059	信达证券	212,600	3,021,046.00	0.08
281	688303	大全能源	142,575	2,907,104.25	0.07
282	688187	时代电气	56,921	2,810,758.98	0.07
283	002603	以岭药业	183,200	2,808,456.00	0.07
284	002410	广联达	290,480	2,782,798.40	0.07
285	300454	深信服	55,000	2,779,150.00	0.07
286	002841	视源股份	92,240	2,723,847.20	0.07
287	300442	润泽科技	112,600	2,696,770.00	0.07
288	603899	晨光股份	81,700	2,555,576.00	0.07
289	688363	华熙生物	42,072	2,380,013.04	0.06
290	601808	中海油服	129,800	2,232,560.00	0.06
291	600732	爱旭股份	243,080	2,199,874.00	0.06
292	603833	欧派家居	39,944	2,139,400.64	0.05
293	601236	红塔证券	314,190	2,017,099.80	0.05
294	300979	华利集团	33,100	2,014,135.00	0.05
295	601698	中国卫通	138,100	1,945,829.00	0.05
296	300957	贝泰妮	37,100	1,792,672.00	0.05
297	000800	一汽解放	207,900	1,627,857.00	0.04
298	688082	盛美上海	19,029	1,608,140.79	0.04
299	603296	华勤技术	20,000	1,104,600.00	0.03
300	001289	龙源电力	33,600	579,600.00	0.01

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	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.01
2	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
3	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
4	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
5	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
6	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
7	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
8	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
9	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
10	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
11	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
12	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
13	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
14	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
15	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
16	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
17	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
18	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
19	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
20	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
21	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
22	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
23	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
24	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
25	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
26	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
27	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
28	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
29	603375	盛景微	72	2,800.80	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	600519	贵州茅台	160,139,909.22	5.13
2	601318	中国平安	68,407,102.07	2.19
3	600036	招商银行	61,195,128.00	1.96
4	600900	长江电力	52,143,475.63	1.67

5	601899	紫金矿业	38,186,820.22	1.22
6	601166	兴业银行	36,497,917.00	1.17
7	600276	恒瑞医药	30,373,844.59	0.97
8	600030	中信证券	29,616,266.00	0.95
9	601398	工商银行	28,061,110.00	0.90
10	600887	伊利股份	27,188,829.00	0.87
11	601328	交通银行	26,958,175.00	0.86
12	600436	片仔癀	23,821,845.14	0.76
13	600309	万华化学	22,438,967.00	0.72
14	603259	药明康德	21,759,107.86	0.70
15	600919	江苏银行	21,443,781.15	0.69
16	600809	山西汾酒	20,766,594.60	0.66
17	601288	农业银行	20,410,423.00	0.65
18	601088	中国神华	20,071,769.00	0.64
19	601816	京沪高铁	19,034,486.00	0.61
20	601012	隆基绿能	19,030,479.76	0.61

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	600519	贵州茅台	136,329,409.16	4.36
2	601318	中国平安	59,227,961.34	1.90
3	600036	招商银行	53,731,164.00	1.72
4	601899	紫金矿业	33,042,493.99	1.06
5	600900	长江电力	32,833,205.00	1.05
6	601166	兴业银行	32,113,652.00	1.03
7	600276	恒瑞医药	26,636,138.32	0.85
8	600030	中信证券	25,383,368.00	0.81
9	600919	江苏银行	24,799,477.00	0.79
10	601398	工商银行	24,628,132.00	0.79
11	600436	片仔癀	24,322,168.93	0.78
12	601328	交通银行	24,130,606.00	0.77
13	600887	伊利股份	23,628,429.10	0.76
14	600028	中国石化	21,310,002.00	0.68
15	600309	万华化学	19,422,035.65	0.62
16	600809	山西汾酒	18,702,603.00	0.60
17	601288	农业银行	17,836,891.00	0.57
18	601088	中国神华	17,828,257.82	0.57
19	603259	药明康德	17,110,430.00	0.55

20	601012	隆基绿能	17,039,556.00	0.55
----	--------	------	---------------	------

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	2,027,807,812.33
卖出股票收入（成交）总额	1,754,178,720.08

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,000.07	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,000.07	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113685	升 24 转债	10	1,000.07	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，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等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。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	3,220,407.40

2	应收清算款	674,814.74
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,895,222.14

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301589	诺瓦星云	233,884.44	0.01	新股锁定期
2	688692	达梦数据	30,612.75	0.00	新股锁定期
3	603285	键邦股份	24,002.55	0.00	新股未上市
4	603350	安乃达	21,608.56	0.00	新股未上市
5	688709	成都华微	19,635.55	0.00	新股锁定期

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
17,786	62,764.02	627,692,628.00	56.23%	95,942,154.00	8.59%	392,686,074.00	35.18%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
----	-------	---------	----------

1	中国人寿保险股份有限公司	144,846,332.00	12.98%
2	国信证券股份有限公司	90,983,545.00	8.15%
3	中信证券股份有限公司	85,568,927.00	7.67%
4	国泰君安证券股份有限公司	66,283,548.00	5.94%
5	华泰证券股份有限公司	52,527,764.00	4.71%
6	海港人寿保险股份有限公司-H 传统 2	27,169,913.00	2.43%
7	广发证券股份有限公司	21,002,144.00	1.88%
8	海通证券股份有限公司	14,829,261.00	1.33%
9	前海人寿保险股份有限公司-分红保险产品	14,000,000.00	1.25%
10	南方基金乐丰混合型养老金产品-中国建设银行股份有限公司	12,455,500.00	1.12%
11	中国工商银行-南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金	392,686,074.00	35.18%

注：持有人名称与注册登记机构持有人名册保持一致。其中：“中国工商银行-南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金”对应的基金全称为“中国工商银行-南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年2月18日)基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,807,199,451.00
本报告期基金总申购份额	952,500,000.00
减：报告期基金总赎回份额	969,600,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-673,778,595.00
本报告期期末基金份额总额	1,116,320,856.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及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	
银河证券	2	3,191,083,061.57	84.42%	319,133.59	84.42%	-
华泰证券	4	260,543,824.64	6.89%	26,055.18	6.89%	-
招商证券	3	155,552,978.14	4.11%	15,555.84	4.11%	-
国信证券	3	86,165,792.76	2.28%	8,616.14	2.28%	-

国泰君安	3	70,762,032.32	1.87%	7,076.61	1.87%	-
中金公司	4	11,059,395.61	0.29%	1,106.04	0.29%	-
申万宏源	2	3,459,754.00	0.09%	345.98	0.09%	-
海通证券	1	1,583,215.00	0.04%	158.26	0.04%	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

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

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

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

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：

招商证券

国信证券

国泰君安

中金公司

中信证券

平安证券

减少交易单元：

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
银河证券	1,057.63	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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以通讯方式召开南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基	证券时报、基金管理人网站、中国证监会	2024-01-02

	金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	基金电子披露网站	
2	南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-03
3	南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金增加一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-03
4	关于南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-05
5	关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-05
6	关于南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-08
7	关于南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-10
8	南方基金管理股份有限公司关于南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额合并业务及相关业务安排的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-23
9	南方基金管理股份有限公司关于南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额合并结果的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-29
10	关于南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会计票日开始停牌的提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-31
11	南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-01
12	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加山西证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-01
13	关于南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-01
14	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-02
15	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-24
16	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加	证券时报、基金管理	2024-03-15

	渤海证券为一级交易商的公告	人网站、中国证监会 基金电子披露网站	
17	南方基金管理股份有限公司关于调低南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金费率并修订基金合同的公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-03-26
18	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-03-29
19	关于南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-04-23
20	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加民生证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-04-24
21	南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式二次召开南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-04-30
22	南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式二次召开南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-05-06
23	南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式二次召开南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-05-07
24	关于调整证券投资基金主流流动性服务商的公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-05-23
25	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-05-30
26	关于南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会（二次召开）计票日开始停牌的提示性公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-06-04
27	南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会（二次召开）会议情况的公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-06-05
28	关于南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-06-06
29	南方基金管理股份有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券时报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-06-20

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20240101-20240630	744,927,719.00	29,136,404.00	381,378,049.00	392,686,074.00	35.18%

产品特有风险

本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

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 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方沪深 300 交易型开放式指数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 交易型开放式指数证券投资基金 2024 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>