

南方沪深 300 指数增强型证券投资基金 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：招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。

基金托管人招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.....	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.....	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）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
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.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§ 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	201,118,302.32 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	142,096,616.29 份	59,021,686.03 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	400-61-95555
	电子邮箱	manager@southernfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-889-8899	400-61-95555
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(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,879,587.11
本期利润	6,253,606.02
加权平均基金份额本期利润	0.0517
本期加权平均净值利润率	4.87%
本期基金份额净值增长率	5.86%
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	10,307,343.53

期末可供分配基金份额利润	0.0725
期末基金资产净值	152,403,959.82
期末基金份额净值	1.0725
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	7.25%

2、南方沪深 300 指数增强 C

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	1,180,359.58
本期利润	4,114,353.74
加权平均基金份额本期利润	0.0662
本期加权平均净值利润率	6.35%
本期基金份额净值增长率	5.66%
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	3,229,811.30
期末可供分配基金份额利润	0.0547
期末基金资产净值	62,251,497.33
期末基金份额净值	1.0547
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	5.47%

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	-2.03%	0.45%	-3.14%	0.46%	1.11%	-0.01%
过去三个月	-0.08%	0.66%	-2.03%	0.72%	1.95%	-0.06%
过去六个月	5.86%	0.83%	0.88%	0.85%	4.98%	-0.02%
过去一年	-3.85%	0.79%	-9.38%	0.83%	5.53%	-0.04%
过去三年	-29.62%	0.97%	-32.20%	0.99%	2.58%	-0.02%
自基金合同	7.25%	1.05%	-9.03%	1.06%	16.28%	-0.01%

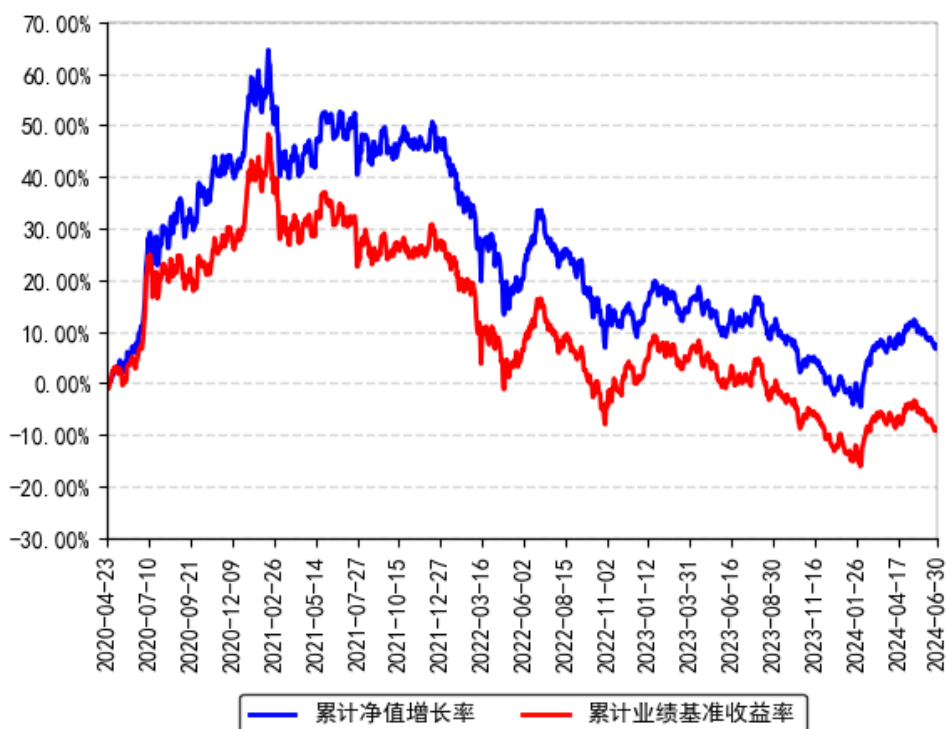
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

南方沪深 300 指数增强 C

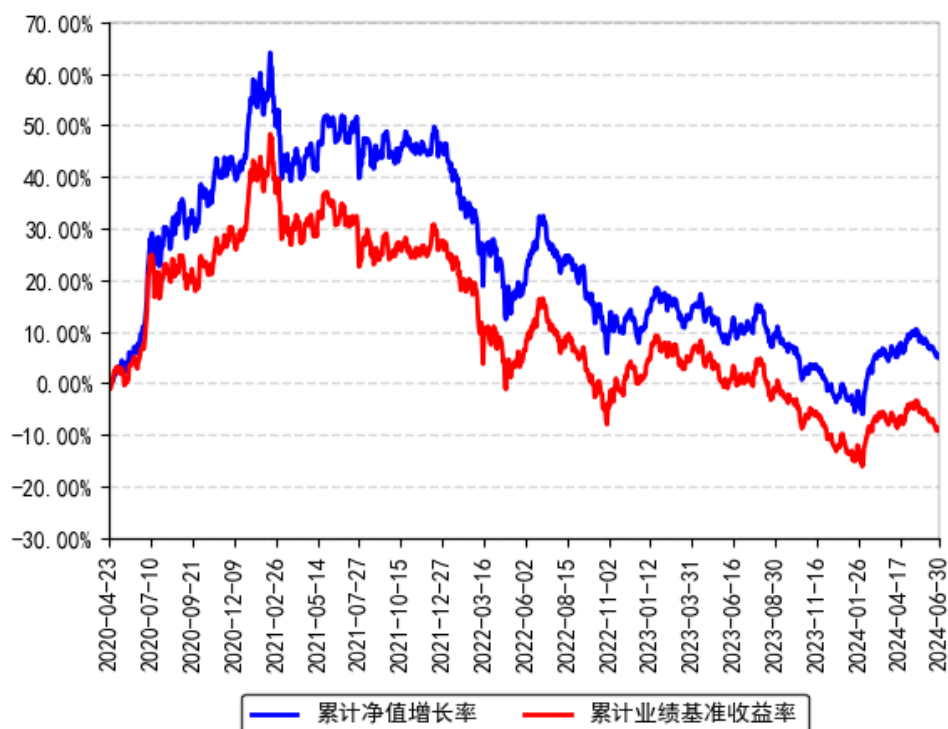
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.06%	0.45%	-3.14%	0.46%	1.08%	-0.01%
过去三个月	-0.19%	0.66%	-2.03%	0.72%	1.84%	-0.06%
过去六个月	5.66%	0.83%	0.88%	0.85%	4.78%	-0.02%
过去一年	-4.24%	0.79%	-9.38%	0.83%	5.14%	-0.04%
过去三年	-30.46%	0.97%	-32.20%	0.99%	1.74%	-0.02%
自基金合同生效起至今	5.47%	1.05%	-9.03%	1.06%	14.50%	-0.01%

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。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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

解锐	本基金基金经理	2022 年 2 月 18 日	-	6 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

2024 年上半年，整体市场维持震荡，一季度大幅波动，在 1 月下跌后强势反弹，二季度呈现震荡下跌格局。具体来看，沪深 300 上涨 0.89%，中证 500 下跌 8.96%，中证 1000 下跌 16.84%，创业板指下跌 10.99%。风格方面轮动剧烈，整体来看低估值、大盘风格占优，成长、小盘表现较弱。行业层面分化明显，银行、煤炭、公用事业涨幅居前，分别上涨 17.02%、11.96%、11.76%，计算机、商贸零售、社会服务跌幅较大，分别下跌 24.88%、24.59%、24.05%。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 1.0725 元，报告期内，份额净值增长率为 5.86%，同期业绩基准增长率为 0.88%；本基金 C 份额净值为 1.0547 元，报告期内，份额净值增长率为 5.66%，同期业绩基准增长率为 0.88%。

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 2024 年下半年，国内始终坚持经济结构转型，制造业的韧性增强，制造业用电量、汽车销量和家电销量增速均处于历史约 P60 以上位置。下半年，经济预计整体平稳复苏，复苏的幅度取决于财政力度，下半年财政或明显发力，核心关注财政政策对于实物工作量的拉动效果。PPI 和 CPI 预计延续回暖，回升的复苏幅度预计温和。综合当前时点 A 股的胜率和赔率来看，我们认为 A 股仍具备投资价值。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：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	17,312,652.18	13,213,445.76
结算备付金		1,205,053.09	505,218.22
存出保证金		11,834.20	12,608.33
交易性金融资产	6.4.3.2	196,478,770.74	156,889,201.21
其中：股票投资		196,478,770.74	156,889,201.21
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		-	172,487.55
应收股利		-	-
应收申购款		326,235.64	307,160.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		215,334,545.85	171,100,121.22
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		-	-
应付赎回款		179,656.94	327,827.70
应付管理人报酬		88,192.62	71,206.13
应付托管费		17,638.54	14,241.22
应付销售服务费		21,481.69	18,661.07

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	372,118.91	374,646.15
负债合计		679,088.70	806,582.27
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	201,118,302.32	168,924,535.66
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	13,537,154.83	1,369,003.29
净资产合计		214,655,457.15	170,293,538.95
负债和净资产总计		215,334,545.85	171,100,121.22

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，南方沪深 300 指数增强 A 份额净值 1.0725 元，基金份额总额 142,096,616.29 份；南方沪深 300 指数增强 C 份额净值 1.0547 元，基金份额总额 59,021,686.03 份；总份额合计 201,118,302.32 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：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		11,259,678.43	646,308.98
1.利息收入		41,271.03	26,281.35
其中：存款利息收入	6.4.3.9	41,271.03	26,281.35
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		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		4,834,486.22	1,652,933.11
其中：股票投资收益	6.4.3.10	2,423,929.48	-596,263.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	1,149.96	5,066.72
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	-	-

股利收益	6.4.3.13	2,409,406.78	2,244,130.32
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	6,308,013.07	-1,049,642.24
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	75,908.11	16,736.76
减：二、营业总支出		891,718.67	805,957.35
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	479,739.73	434,948.82
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.6.2.2	95,947.95	86,989.63
3.销售服务费	6.4.6.2.3	129,297.54	97,071.98
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
8.其他费用	6.4.3.16	186,733.45	186,946.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,367,959.76	-159,648.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,367,959.76	-159,648.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,367,959.76	-159,648.37

6.3 净资产变动表

会计主体：南方沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：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	168,924,535.66	-	1,369,003.29	170,293,538.95
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	168,924,535.66	-	1,369,003.29	170,293,538.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	32,193,766.66	-	12,168,151.54	44,361,918.20
（一）、综合收益总额	-	-	10,367,959.76	10,367,959.76
（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）	32,193,766.66	-	1,800,191.78	33,993,958.44
其中：1.基金申购款	80,647,953.15	-	4,748,629.16	85,396,582.31
2.基金赎回款	-48,454,186.49	-	-2,948,437.38	-51,402,623.87
（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	201,118,302.32	-	13,537,154.83	214,655,457.15
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	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	151,503,862.48	-	17,127,671.93	168,631,534.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,145,426.29	-	213,706.70	4,359,132.99

(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净资产变动数 (净资产减少以“-”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	155,649,288.77	-	17,341,378.63	172,990,667.40

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	17,312,652.18
等于：本金	17,310,877.22
加：应计利息	1,774.96
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	17,312,652.18

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	200,009,406.28	-	196,478,770.74	-3,530,635.54
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	200,009,406.28	-	196,478,770.74	-3,530,635.54

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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	132.34
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	237,451.21
其中：交易所市场	237,451.21
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
应付指数使用费	50,000.00
合计	372,118.91

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 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	112,405,450.28	112,405,450.28
本期申购	46,011,950.59	46,011,950.59
本期赎回（以“-”号填列）	-16,320,784.58	-16,320,784.58
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	142,096,616.29	142,096,616.29

南方沪深 300 指数增强 C		
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	56,519,085.38	56,519,085.38
本期申购	34,636,002.56	34,636,002.56
本期赎回（以“-”号填列）	-32,133,401.91	-32,133,401.91
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	59,021,686.03	59,021,686.03

注：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。

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	10,595,911.58	-9,126,741.07	1,469,170.51
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	10,595,911.58	-9,126,741.07	1,469,170.51
本期利润	2,879,587.11	3,374,018.91	6,253,606.02
本期基金份额交易产生的变动数	2,745,479.48	-160,912.48	2,584,567.00
其中：基金申购款	4,162,454.27	-508,104.14	3,654,350.13
基金赎回款	-1,416,974.79	347,191.66	-1,069,783.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,220,978.17	-5,913,634.64	10,307,343.53

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	4,374,580.71	-4,474,747.93	-100,167.22
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,374,580.71	-4,474,747.93	-100,167.22
本期利润	1,180,359.58	2,933,994.16	4,114,353.74
本期基金份额交易产生的变动数	43,829.87	-828,205.09	-784,375.22
其中：基金申购款	2,042,651.34	-948,372.31	1,094,279.03
基金赎回款	-1,998,821.47	120,167.22	-1,878,654.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,598,770.16	-2,368,958.86	3,229,811.30

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	29,157.58
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	11,641.77
其他	471.68
合计	41,271.03

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	421,012,445.42
减：卖出股票成本总额	417,862,874.04
减：交易费用	725,641.90
买卖股票差价收入	2,423,929.48

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.11 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	0.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,149.84
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	1,149.96

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	2,150.05
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	0.12
减：交易费用	0.09
买卖债券差价收入	1,149.84

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,409,406.78
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	2,409,406.78

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	6,308,013.07
——股票投资	6,308,013.07
——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	6,308,013.07

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	70,533.17
基金转换费收入	5,374.94
合计	75,908.11

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	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
银行费用	2,192.92
其他	5.17
合计	186,733.45

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

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

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 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	81,571,477.92	9.36%	-	-
兴业证券	4,761,221.67	0.55%	-	-

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 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	8,157.18	1.78%	7,328.95	3.09%
兴业证券	475.95	0.10%	475.95	0.20%
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	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-

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 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管理费	479,739.73	434,948.82
其中：应支付销售机构的客户维护费	153,434.37	143,471.30
应支付基金管理人的净管理费	326,305.36	291,477.52

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 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 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	95,947.95	86,989.63

注：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：

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	1,356.01	1,356.01
南方基金	-	26,411.21	26,411.21
招商银行	-	13,951.22	13,951.22
合计	-	41,718.44	41,718.44
获得销售服务费的各关联方名称	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

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：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.40%÷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 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
招商银行	17,312,652.18	29,157.58	13,603,225.29	20,954.86

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	3,413	53,549.97
华泰联合	301587	中瑞股份	网下申购	2,231	48,479.63
华泰联合	603341	龙旗科技	网下申购	945	24,570.00
华泰联合	603312	西典新能	网下申购	609	17,673.18
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	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

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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（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
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新股未上市	20.56	20.56	1,003	20,621.68	20,621.68	-
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	1,019	19,004.35	19,004.35	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定期	86.96	174.93	70	6,087.20	12,245.10	-
301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定期	55.82	91.24	88	4,912.16	8,029.12	-
301538	骏鼎达	2024 年 5 月	1-6 个月（含）	锁定期转增	-	91.24	35	-	3,193.40	-

		22 日								
301536	星宸科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	16.16	32.27	330	5,332.80	10,649.10	-
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	11.88	18.98	488	5,797.44	9,262.24	-
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	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	19.86	42.51	192	3,813.12	8,161.92	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	44.95	65.93	122	5,483.90	8,043.46	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股锁 定期	8.90	16.97	441	3,924.90	7,483.77	-
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	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	15.69	18.79	342	5,365.98	6,426.18	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	21.73	25.26	224	4,867.52	5,658.24	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	22.43	31.55	174	3,902.82	5,489.70	-
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	17.43	34.56	147	2,562.21	5,080.32	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	22.66	15.89	268	6,072.88	4,258.52	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股锁 定期	26.00	37.49	95	2,470.00	3,561.55	-
001359	平安电工	2024	6 个月	新股锁	17.39	20.60	120	2,086.80	2,472.00	-

		年 3 月 19 日		定期						
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定期	19.18	22.66	107	2,052.26	2,424.62	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股锁定期	21.28	29.49	74	1,574.72	2,182.26	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期	23.35	25.13	84	1,961.40	2,110.92	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股锁定期	72.46	68.06	25	1,811.50	1,701.50	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股锁定期	38.18	38.90	43	1,641.74	1,672.70	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定期	29.02	25.36	61	1,770.22	1,546.96	-

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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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，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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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。

于本期末，本基金的卖出回购金融资产款（若有）计息且利息金额不重大；除此之外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，该部分账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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，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。

本基金的基金管理人对基金组合资产中 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。于本期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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	17,312,652.18	-	-	-	17,312,652.18
结算备付金	1,205,053.09	-	-	-	1,205,053.09
存出保证金	11,834.20	-	-	-	11,834.20
交易性金融资产	-	-	-	196,478,770.74	196,478,770.74
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	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	56,550.22	-	-	269,685.42	326,235.64
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	18,586,089.69	-	-	196,748,456.16	215,334,545.85
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	-	-	-	179,656.94	179,656.94
应付管理人报酬	-	-	-	88,192.62	88,192.62
应付托管费	-	-	-	17,638.54	17,638.54
应付销售服务费	-	-	-	21,481.69	21,481.69
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	-	-	-	372,118.91	372,118.91
负债总计	-	-	-	679,088.70	679,088.70
利率敏感度缺口	18,586,089.69	-	-	196,069,367.46	214,655,457.15
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	13,213,445.76	-	-	-	13,213,445.76
结算备付金	505,218.22	-	-	-	505,218.22
存出保证金	12,608.33	-	-	-	12,608.33
交易性金融资产	-	-	-	156,889,201.21	156,889,201.21
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	-	-	-	172,487.55	172,487.55
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	40,956.76	-	-	266,203.39	307,160.15
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,772,229.07	-	-	157,327,892.15	171,100,121.22
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	-	-	-	327,827.70	327,827.70
应付管理人报酬	-	-	-	71,206.13	71,206.13
应付托管费	-	-	-	14,241.22	14,241.22
应付销售服务费	-	-	-	18,661.07	18,661.07
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	-	-	-	374,646.15	374,646.15
负债总计	-	-	-	806,582.27	806,582.27
利率敏感度	13,772,229.0			156,521,309.	170,293,538.
缺口	7	-	-	88	95

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 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	196,478,770.74	91.53	156,889,201.21	92.13
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	196,478,770.74	91.53	156,889,201.21	92.13

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%	9,922,372.29	7,666,760.18
	2.组合自身基准下降 5%	-9,922,372.29	-7,666,760.18

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	196,305,674.17
第二层次	39,626.03
第三层次	133,470.54
合计	196,478,770.74

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	196,478,770.74	91.24
	其中：股票	196,478,770.74	91.24
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	18,517,705.27	8.60
8	其他各项资产	338,069.84	0.16
9	合计	215,334,545.85	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

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	815,348.00	0.38
B	采矿业	11,030,149.00	5.14
C	制造业	96,699,665.10	45.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,167,430.00	3.80
E	建筑业	4,465,705.80	2.08
F	批发和零售业	561,762.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	7,585,082.00	3.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,628,230.59	3.55
J	金融业	36,091,655.99	16.81
K	房地产业	1,477,785.00	0.69
L	租赁和商务服务业	1,390,725.00	0.65
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	175,913,538.48	81.95

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	261,491.00	0.12
C	制造业	13,528,085.93	6.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,275,281.00	0.59
E	建筑业	18,225.00	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	562,742.00	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,463,455.99	0.68
J	金融业	1,801,370.00	0.84
K	房地产业	761,282.00	0.35
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	281,048.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	523,946.34	0.24
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	88,305.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	20,565,232.26	9.58

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	601318	中国平安	125,600	5,194,816.00	2.42
2	600519	贵州茅台	3,300	4,842,387.00	2.26
3	600000	浦发银行	431,800	3,553,714.00	1.66
4	600887	伊利股份	133,200	3,441,888.00	1.60
5	000333	美的集团	48,800	3,147,600.00	1.47
6	002001	新和成	163,100	3,131,520.00	1.46
7	600926	杭州银行	207,052	2,702,028.60	1.26
8	601169	北京银行	459,100	2,681,144.00	1.25
9	002601	龙佰集团	143,900	2,672,223.00	1.24
10	300760	迈瑞医疗	8,800	2,560,008.00	1.19
11	300433	蓝思科技	134,800	2,460,100.00	1.15
12	600809	山西汾酒	11,500	2,425,120.00	1.13
13	603993	洛阳钼业	284,900	2,421,650.00	1.13
14	000725	京东方 A	587,100	2,401,239.00	1.12
15	603501	韦尔股份	24,100	2,394,817.00	1.12
16	688036	传音控股	30,955	2,369,295.70	1.10
17	600938	中国海油	67,600	2,230,800.00	1.04
18	300750	宁德时代	12,140	2,185,564.20	1.02
19	601899	紫金矿业	124,300	2,183,951.00	1.02
20	601166	兴业银行	121,900	2,147,878.00	1.00
21	601601	中国太保	68,200	1,900,052.00	0.89
22	000858	五粮液	14,800	1,894,992.00	0.88
23	601633	长城汽车	73,700	1,864,610.00	0.87
24	601919	中远海控	115,800	1,793,742.00	0.84
25	601916	浙商银行	639,100	1,763,916.00	0.82
26	000338	潍柴动力	108,000	1,753,920.00	0.82
27	000568	泸州老窖	12,207	1,751,582.43	0.82

28	000596	古井贡酒	8,200	1,730,774.00	0.81
29	601728	中国电信	280,400	1,724,460.00	0.80
30	002371	北方华创	5,300	1,695,417.00	0.79
31	002475	立讯精密	40,200	1,580,262.00	0.74
32	600016	民生银行	412,000	1,561,480.00	0.73
33	600219	南山铝业	409,100	1,558,671.00	0.73
34	000786	北新建材	50,600	1,500,796.00	0.70
35	600346	恒力石化	104,000	1,450,800.00	0.68
36	300308	中际旭创	10,460	1,442,224.80	0.67
37	600795	国电电力	238,000	1,425,620.00	0.66
38	600039	四川路桥	176,840	1,395,267.60	0.65
39	600900	长江电力	48,000	1,388,160.00	0.65
40	002415	海康威视	44,500	1,375,495.00	0.64
41	600332	白云山	46,700	1,369,711.00	0.64
42	600919	江苏银行	177,300	1,317,339.00	0.61
43	600018	上港集团	227,100	1,312,638.00	0.61
44	600050	中国联通	278,000	1,306,600.00	0.61
45	601689	拓普集团	24,300	1,302,723.00	0.61
46	603806	福斯特	88,060	1,294,482.00	0.60
47	601398	工商银行	226,300	1,289,910.00	0.60
48	002027	分众传媒	209,900	1,271,994.00	0.59
49	000651	格力电器	32,200	1,262,884.00	0.59
50	003816	中国广核	269,000	1,245,470.00	0.58
51	600406	国电南瑞	49,700	1,240,512.00	0.58
52	600989	宝丰能源	71,500	1,239,095.00	0.58
53	300979	华利集团	20,100	1,223,085.00	0.57
54	601872	招商轮船	142,200	1,201,590.00	0.56
55	600690	海尔智家	42,200	1,197,636.00	0.56
56	600276	恒瑞医药	31,100	1,196,106.00	0.56
57	601328	交通银行	136,600	1,020,402.00	0.48
58	600875	东方电气	55,100	1,016,595.00	0.47
59	601818	光大银行	319,400	1,012,498.00	0.47
60	600115	中国东航	250,900	1,006,109.00	0.47
61	600547	山东黄金	36,000	985,680.00	0.46
62	601799	星宇股份	8,500	952,340.00	0.44
63	600183	生益科技	45,000	947,700.00	0.44
64	601865	福莱特	46,864	941,966.40	0.44
65	600941	中国移动	8,600	924,500.00	0.43
66	600023	浙能电力	129,200	918,612.00	0.43
67	601088	中国神华	20,500	909,585.00	0.42
68	002311	海大集团	19,100	898,655.00	0.42
69	002252	上海莱士	114,100	892,262.00	0.42
70	601988	中国银行	191,000	882,420.00	0.41

71	600660	福耀玻璃	18,400	881,360.00	0.41
72	605499	东鹏饮料	4,000	863,000.00	0.40
73	601668	中国建筑	154,300	819,333.00	0.38
74	601100	恒立液压	17,300	805,834.00	0.38
75	601985	中国核电	75,300	802,698.00	0.37
76	002179	中航光电	20,830	792,581.50	0.37
77	688111	金山办公	3,416	777,140.00	0.36
78	300408	三环集团	26,600	776,454.00	0.36
79	603195	公牛集团	10,060	775,827.20	0.36
80	600362	江西铜业	32,550	770,784.00	0.36
81	600015	华夏银行	118,200	756,480.00	0.35
82	002648	卫星化学	42,039	755,861.22	0.35
83	601816	京沪高铁	140,500	754,485.00	0.35
84	601658	邮储银行	147,000	745,290.00	0.35
85	600030	中信证券	40,800	743,784.00	0.35
86	000157	中联重科	92,100	707,328.00	0.33
87	600048	保利发展	80,700	706,932.00	0.33
88	000166	申万宏源	163,000	702,530.00	0.33
89	601288	农业银行	161,100	702,396.00	0.33
90	600025	华能水电	61,800	666,204.00	0.31
91	600489	中金黄金	45,000	666,000.00	0.31
92	601838	成都银行	43,700	663,803.00	0.31
93	002916	深南电路	6,200	655,774.00	0.31
94	002236	大华股份	42,400	655,504.00	0.31
95	601138	工业富联	23,800	652,120.00	0.30
96	002736	国信证券	74,001	643,068.69	0.30
97	601211	国泰君安	46,800	634,140.00	0.30
98	601319	中国人保	120,400	620,060.00	0.29
99	600372	中航机载	51,500	616,455.00	0.29
100	601618	中国中冶	194,512	602,987.20	0.28
101	000100	TCL 科技	139,500	602,640.00	0.28
102	600309	万华化学	7,400	598,364.00	0.28
103	688223	晶科能源	80,962	574,830.20	0.27
104	601021	春秋航空	10,100	568,933.00	0.27
105	002841	视源股份	19,100	564,023.00	0.26
106	600845	宝信软件	17,640	563,245.20	0.26
107	000963	华东医药	20,200	561,762.00	0.26
108	300751	迈为股份	4,700	561,556.00	0.26
109	600150	中国船舶	13,600	553,656.00	0.26
110	002594	比亚迪	2,210	553,052.50	0.26
111	688187	时代电气	10,838	535,180.44	0.25
112	002241	歌尔股份	27,300	532,623.00	0.25
113	000538	云南白药	10,400	531,960.00	0.25

114	601628	中国人寿	16,600	515,430.00	0.24
115	603288	海天味业	14,800	510,156.00	0.24
116	002714	牧原股份	11,700	510,120.00	0.24
117	000733	振华科技	12,200	506,666.00	0.24
118	601868	中国能建	234,600	497,352.00	0.23
119	002493	荣盛石化	51,300	495,558.00	0.23
120	002304	洋河股份	6,100	492,514.00	0.23
121	000661	长春高新	5,300	486,381.00	0.23
122	600958	东方证券	59,712	453,811.20	0.21
123	600760	中航沈飞	11,240	450,724.00	0.21
124	001289	龙源电力	25,500	439,875.00	0.20
125	688303	大全能源	21,378	435,897.42	0.20
126	605117	德业股份	5,800	431,172.00	0.20
127	600886	国投电力	23,500	428,640.00	0.20
128	601390	中国中铁	63,500	414,020.00	0.19
129	001979	招商蛇口	46,700	410,493.00	0.19
130	300628	亿联网络	10,900	400,793.00	0.19
131	601669	中国电建	69,200	386,828.00	0.18
132	601600	中国铝业	50,400	384,552.00	0.18
133	600028	中国石化	60,300	381,096.00	0.18
134	600426	华鲁恒升	14,300	380,952.00	0.18
135	300999	金龙鱼	13,500	369,225.00	0.17
136	000002	万科 A	52,000	360,360.00	0.17
137	600029	南方航空	59,900	352,811.00	0.16
138	600585	海螺水泥	14,900	351,491.00	0.16
139	601111	中国国航	47,100	347,598.00	0.16
140	000876	新希望	36,800	336,352.00	0.16
141	688396	华润微	8,950	335,088.00	0.16
142	300059	东方财富	31,700	334,752.00	0.16
143	603369	今世缘	7,200	332,640.00	0.15
144	600570	恒生电子	18,500	326,710.00	0.15
145	600011	华能国际	33,900	326,118.00	0.15
146	002555	三七互娱	24,900	324,945.00	0.15
147	600132	重庆啤酒	5,300	321,710.00	0.15
148	300782	卓胜微	4,100	318,734.00	0.15
149	601186	中国铁建	36,600	313,662.00	0.15
150	600436	片仔癀	1,500	310,755.00	0.14
151	600176	中国巨石	28,100	310,505.00	0.14
152	300450	先导智能	18,400	305,992.00	0.14
153	300498	温氏股份	15,400	305,228.00	0.14
154	002920	德赛西威	3,500	304,815.00	0.14
155	000708	中信特钢	22,300	302,611.00	0.14
156	601225	陕西煤业	11,700	301,509.00	0.14

157	601857	中国石油	28,700	296,184.00	0.14
158	600600	青岛啤酒	4,000	291,080.00	0.14
159	601808	中海油服	16,000	275,200.00	0.13
160	002050	三花智控	14,300	272,844.00	0.13
161	600674	川投能源	14,300	268,125.00	0.12
162	000001	平安银行	22,700	230,405.00	0.11
163	600019	宝钢股份	34,500	229,425.00	0.11
164	601059	信达证券	15,500	220,255.00	0.10
165	688126	沪硅产业	15,549	214,731.69	0.10
166	601939	建设银行	28,400	210,160.00	0.10
167	000983	山西焦煤	20,100	207,231.00	0.10
168	688256	寒武纪	937	186,153.79	0.09
169	300124	汇川技术	3,400	174,420.00	0.08
170	300661	圣邦股份	2,100	173,838.00	0.08
171	600188	兖矿能源	7,400	168,202.00	0.08
172	000425	徐工机械	22,800	163,020.00	0.08
173	301269	华大九天	2,100	161,805.00	0.08
174	600905	三峡能源	35,300	153,908.00	0.07
175	300274	阳光电源	2,380	147,631.40	0.07
176	600438	通威股份	7,500	143,325.00	0.07
177	600089	特变电工	10,300	142,861.00	0.07
178	000063	中兴通讯	5,000	139,850.00	0.07
179	002352	顺丰控股	3,900	139,191.00	0.06
180	603260	合盛硅业	2,900	135,459.00	0.06
181	601229	上海银行	17,700	128,502.00	0.06
182	600584	长电科技	3,800	120,498.00	0.06
183	601998	中信银行	17,800	119,260.00	0.06
184	601888	中国中免	1,900	118,731.00	0.06
185	600893	航发动力	3,200	116,960.00	0.05
186	002938	鹏鼎控股	2,800	111,328.00	0.05
187	002180	纳思达	4,200	110,964.00	0.05
188	600233	圆通速递	6,900	107,985.00	0.05
189	600803	新奥股份	5,000	104,000.00	0.05
190	300122	智飞生物	3,500	98,105.00	0.05
191	002410	广联达	9,620	92,159.60	0.04
192	000776	广发证券	7,400	90,058.00	0.04
193	000625	长安汽车	6,300	84,609.00	0.04
194	601901	方正证券	10,200	78,846.00	0.04
195	603019	中科曙光	1,700	70,550.00	0.03
196	601788	光大证券	4,800	70,176.00	0.03
197	601995	中金公司	2,200	65,142.00	0.03
198	601066	中信建投	3,300	63,492.00	0.03
199	601881	中国银河	5,500	59,730.00	0.03

200	601878	浙商证券	4,900	52,528.00	0.02
201	300316	晶盛机电	1,700	48,841.00	0.02
202	000800	一汽解放	5,800	45,414.00	0.02
203	300033	同花顺	400	41,480.00	0.02
204	600918	中泰证券	6,900	39,123.00	0.02
205	002466	天齐锂业	1,300	38,883.00	0.02
206	600061	国投资本	6,500	36,725.00	0.02
207	601117	中国化学	4,400	36,256.00	0.02
208	000977	浪潮信息	800	29,096.00	0.01
209	601236	红塔证券	3,600	23,112.00	0.01
210	601238	广汽集团	2,600	20,124.00	0.01
211	601336	新华保险	650	19,519.50	0.01
212	300896	爱美客	100	17,210.00	0.01
213	601699	潞安环能	100	1,813.00	0.00
214	601898	中煤能源	100	1,248.00	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

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	600642	申能股份	91,900	811,477.00	0.38
2	601058	赛轮轮胎	57,400	803,600.00	0.37
3	601717	郑煤机	50,100	741,480.00	0.35
4	601636	旗滨集团	97,100	626,295.00	0.29
5	002797	第一创业	110,500	562,445.00	0.26
6	002600	领益智造	73,400	522,608.00	0.24
7	000069	华侨城 A	253,800	517,752.00	0.24
8	601615	明阳智能	54,400	513,536.00	0.24
9	000877	天山股份	92,900	501,660.00	0.23
10	603228	景旺电子	13,900	442,020.00	0.21
11	300383	光环新网	43,400	366,730.00	0.17
12	603927	中科软	20,200	365,418.00	0.17
13	600517	国网英大	83,200	360,256.00	0.17
14	002249	大洋电机	75,800	358,534.00	0.17
15	601567	三星医疗	10,211	357,385.00	0.17
16	600535	天士力	26,600	334,628.00	0.16
17	603053	成都燃气	34,000	328,440.00	0.15
18	688188	柏楚电子	1,731	319,456.05	0.15
19	300677	英科医疗	10,900	292,229.00	0.14
20	603568	伟明环保	13,600	279,888.00	0.13
21	002008	大族激光	13,300	276,640.00	0.13
22	601198	东兴证券	34,400	273,824.00	0.13

23	000563	陕国投 A	99,500	273,625.00	0.13
24	000703	恒逸石化	37,700	267,293.00	0.12
25	688169	石头科技	680	266,968.00	0.12
26	600717	天津港	61,900	264,313.00	0.12
27	600066	宇通客车	10,200	263,160.00	0.12
28	600737	中粮糖业	27,400	262,766.00	0.12
29	300207	欣旺达	17,000	257,890.00	0.12
30	002557	洽洽食品	8,700	245,253.00	0.11
31	000581	威孚高科	14,600	237,688.00	0.11
32	001872	招商港口	12,300	236,775.00	0.11
33	601179	中国西电	29,400	236,376.00	0.11
34	688578	艾力斯	3,680	234,563.20	0.11
35	601311	骆驼股份	28,600	229,372.00	0.11
36	000423	东阿阿胶	3,600	225,360.00	0.10
37	601512	中新集团	28,700	218,694.00	0.10
38	002978	安宁股份	7,600	211,736.00	0.10
39	300394	天孚通信	2,380	210,439.60	0.10
40	688561	奇安信	8,681	205,045.22	0.10
41	300815	玉禾田	17,500	203,700.00	0.09
42	603556	海兴电力	4,100	192,003.00	0.09
43	688065	凯赛生物	4,202	190,728.78	0.09
44	603093	南华期货	22,000	190,520.00	0.09
45	600038	中直股份	4,500	184,995.00	0.09
46	600285	羚锐制药	7,600	183,996.00	0.09
47	600160	巨化股份	7,600	183,388.00	0.09
48	300017	网宿科技	22,900	180,910.00	0.08
49	300492	华图山鼎	1,800	169,560.00	0.08
50	688289	圣湘生物	9,370	164,724.60	0.08
51	688336	三生国健	7,922	161,212.70	0.08
52	601500	通用股份	29,300	156,462.00	0.07
53	002053	云南能投	12,900	155,961.00	0.07
54	603486	科沃斯	3,300	155,694.00	0.07
55	603025	大豪科技	11,200	154,784.00	0.07
56	600703	三安光电	12,900	151,188.00	0.07
57	300502	新易盛	1,400	147,770.00	0.07
58	600707	彩虹股份	21,600	147,096.00	0.07
59	600197	伊力特	8,100	144,261.00	0.07
60	002840	华统股份	8,600	142,674.00	0.07
61	002939	长城证券	21,000	140,700.00	0.07
62	002340	格林美	22,000	140,140.00	0.07
63	000544	中原环保	17,200	135,364.00	0.06
64	002463	沪电股份	3,700	135,050.00	0.06
65	300573	兴齐眼药	820	134,480.00	0.06

66	603605	珀莱雅	1,160	128,748.40	0.06
67	002035	华帝股份	20,500	127,715.00	0.06
68	600742	一汽富维	16,700	124,415.00	0.06
69	301301	川宁生物	9,600	122,688.00	0.06
70	002028	思源电气	1,800	120,420.00	0.06
71	002318	久立特材	4,900	114,317.00	0.05
72	603909	建发合诚	13,400	111,488.00	0.05
73	300251	光线传媒	10,500	88,305.00	0.04
74	002381	双箭股份	12,300	82,533.00	0.04
75	603786	科博达	1,200	76,980.00	0.04
76	002171	楚江新材	11,400	75,126.00	0.03
77	002078	太阳纸业	5,300	73,935.00	0.03
78	601127	赛力斯	800	72,896.00	0.03
79	003000	劲仔食品	5,400	65,070.00	0.03
80	600548	深高速	5,800	61,654.00	0.03
81	605099	共创草坪	2,900	54,839.00	0.03
82	000930	中粮科技	10,300	51,809.00	0.02
83	000039	中集集团	5,300	49,078.00	0.02
84	688093	世华科技	2,562	46,551.54	0.02
85	300741	华宝股份	2,800	42,672.00	0.02
86	600882	妙可蓝多	3,300	41,151.00	0.02
87	688057	金达莱	4,114	40,358.34	0.02
88	301207	华兰疫苗	1,700	30,039.00	0.01
89	002891	中宠股份	1,400	29,218.00	0.01
90	601126	四方股份	1,500	28,830.00	0.01
91	688138	清溢光电	1,306	28,079.00	0.01
92	002128	电投能源	1,200	25,320.00	0.01
93	601155	新城控股	2,800	24,836.00	0.01
94	688571	杭华股份	4,680	24,757.20	0.01
95	000975	山金国际	1,500	24,435.00	0.01
96	603350	安乃达	1,003	20,621.68	0.01
97	603285	键邦股份	1,019	19,004.35	0.01
98	600606	绿地控股	13,500	18,225.00	0.01
99	688278	特宝生物	336	17,992.80	0.01
100	688692	达梦数据	70	12,245.10	0.01
101	600186	莲花控股	3,500	12,005.00	0.01
102	301538	骏鼎达	123	11,222.52	0.01
103	301536	星宸科技	330	10,649.10	0.00
104	301565	中仑新材	488	9,262.24	0.00
105	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
106	688691	灿芯股份	192	8,161.92	0.00
107	301580	爱迪特	122	8,043.46	0.00
108	301566	达利凯普	441	7,483.77	0.00

109	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
110	688709	成都华微	342	6,426.18	0.00
111	301587	中瑞股份	224	5,658.24	0.00
112	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
113	688695	中创股份	174	5,489.70	0.00
114	001389	广合科技	147	5,080.32	0.00
115	301578	辰奕智能	118	4,669.26	0.00
116	688584	上海合晶	268	4,258.52	0.00
117	603341	龙旗科技	95	3,561.55	0.00
118	001359	平安电工	120	2,472.00	0.00
119	603344	星德胜	107	2,424.62	0.00
120	603082	北自科技	74	2,182.26	0.00
121	603381	永臻股份	84	2,110.92	0.00
122	603325	博隆技术	25	1,701.50	0.00
123	603375	盛景微	43	1,672.70	0.00
124	603312	西典新能	61	1,546.96	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	600887	伊利股份	5,419,165.00	3.18
2	601318	中国平安	5,013,495.00	2.94
3	600989	宝丰能源	4,728,627.00	2.78
4	002601	龙佰集团	4,262,293.00	2.50
5	600000	浦发银行	4,068,139.00	2.39
6	600809	山西汾酒	3,993,564.00	2.35
7	603501	韦尔股份	3,774,050.00	2.22
8	000725	京东方 A	3,745,124.00	2.20
9	600926	杭州银行	3,719,440.00	2.18
10	002001	新和成	3,688,414.60	2.17
11	600938	中国海油	3,549,491.00	2.08
12	601899	紫金矿业	3,333,979.00	1.96
13	000651	格力电器	3,321,662.00	1.95
14	600795	国电电力	3,253,858.00	1.91
15	600023	浙能电力	3,205,121.00	1.88
16	002311	海大集团	3,203,932.00	1.88
17	300760	迈瑞医疗	3,177,446.00	1.87
18	600016	民生银行	3,099,437.00	1.82
19	600660	福耀玻璃	3,069,303.00	1.80
20	601988	中国银行	3,048,366.00	1.79

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	600025	华能水电	4,559,351.21	2.68
2	601211	国泰君安	4,481,823.93	2.63
3	002648	卫星化学	4,192,219.00	2.46
4	601857	中国石油	4,007,101.00	2.35
5	000651	格力电器	3,979,438.00	2.34
6	600019	宝钢股份	3,938,093.00	2.31
7	600989	宝丰能源	3,750,623.00	2.20
8	600887	伊利股份	3,482,478.00	2.04
9	600919	江苏银行	3,472,665.00	2.04
10	601998	中信银行	3,462,217.00	2.03
11	000338	潍柴动力	3,293,795.00	1.93
12	600660	福耀玻璃	3,182,767.00	1.87
13	600028	中国石化	3,080,386.10	1.81
14	688036	传音控股	3,032,575.56	1.78
15	000568	泸州老窖	2,974,125.00	1.75
16	601898	中煤能源	2,936,468.00	1.72
17	601390	中国中铁	2,885,384.00	1.69
18	000100	TCL 科技	2,868,332.00	1.68
19	002311	海大集团	2,761,647.00	1.62
20	601668	中国建筑	2,748,411.00	1.61

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	451,144,430.50
卖出股票收入（成交）总额	421,012,445.42

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，北京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北京监管局的处罚；杭州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浙江监管局的处罚。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	11,834.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	326,235.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	338,069.84

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

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	5,476	25,948.98	21,107,541.88	14.85%	120,989,074.41	85.15%
南方沪深 300 指数增强 C	3,556	16,597.77	-	-	59,021,686.03	100.00%
合计	9,032	22,267.31	21,107,541.88	10.50%	180,010,760.44	89.50%

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	545,421.82	0.3838%
	南方沪深 300 指数增强 C	118,973.38	0.2016%
	合计	664,395.20	0.3304%

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	112,405,450.28	56,519,085.38
本报告期基金总申购份额	46,011,950.59	34,636,002.56
减：报告期基金总赎回份额	16,320,784.58	32,133,401.91
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	142,096,616.29	59,021,686.03

§ 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	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	
国投证券	2	187,714,764.03	21.54%	175,004.27	38.11%	-
银河证券	1	174,803,835.65	20.06%	17,480.37	3.81%	-
东北证券	1	97,066,810.10	11.14%	71,431.64	15.55%	-
长城证券	1	83,695,064.28	9.61%	78,330.06	17.06%	-
华泰证券	3	81,571,477.92	9.36%	8,157.18	1.78%	-
招商证券	1	76,608,189.59	8.79%	7,660.80	1.67%	-
中信建投	2	75,271,492.56	8.64%	23,906.56	5.21%	-
广发证券	1	44,615,768.00	5.12%	41,756.91	9.09%	-
浙商证券	1	15,738,150.10	1.81%	12,048.30	2.62%	-
华西证券	3	7,904,282.50	0.91%	5,817.09	1.27%	-
东财证券	1	6,697,239.27	0.77%	4,928.78	1.07%	-
平安证券	1	5,669,948.75	0.65%	3,605.58	0.79%	-
兴业证券	1	4,761,221.67	0.55%	475.95	0.10%	-
海通证券	1	3,315,325.00	0.38%	3,102.76	0.68%	-
财通证券	1	2,977,465.00	0.34%	2,786.67	0.61%	-
信达证券	1	2,914,746.32	0.33%	2,727.87	0.59%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海 证券	1	-	-	-	-	-
金圆统一 证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	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：

无

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
国投证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	2,150.05	100.00%	-	-	-	-
东财证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	-	-	-	-	-	-
金圆统一证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

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	2024-01-06
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	2024-02-02
3	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	2024-02-24
4	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	2024-03-29
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	2024-05-30
6	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	证券日报、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

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 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>