

南方大数据 300 指数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告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.....	49
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	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.....	57
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方大数据 300 指数证券投资基金	
基金简称	南方大数据 300 指数	
基金主代码	001420	
交易代码	001420	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 24 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	166,214,505.20 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方大数据 300 指数 A	南方大数据 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	001420	001426
报告期末下属分级基金的份额总额	138,599,207.82 份	27,615,297.38 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，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。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 6%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	大数据 300 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	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、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限	中国建设银行股份有限公司

	姓名	常克川	王小飞
信息披露负责人	联系电话	0755-82763888	021-60637103
	电子邮箱	manager@southernfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	021-60637228
传真		0755-82763889	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518017	100033
法定代表人		周易	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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、南方大数据 300 指数 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,333,835.73
本期利润	15,578,545.68
加权平均基金份额本期利润	0.1115
本期加权平均净值利润率	8.52%
本期基金份额净值增长率	9.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	46,160,769.07
期末可供分配基金份额利润	0.3330
期末基金资产净值	184,759,976.89
期末基金份额净值	1.3331
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	33.31%

2、南方大数据 300 指数 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-593,997.35
本期利润	2,864,836.41
加权平均基金份额本期利润	0.1059
本期加权平均净值利润率	8.33%
本期基金份额净值增长率	8.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	8,114,706.60
期末可供分配基金份额利润	0.2938
期末基金资产净值	35,730,003.98
期末基金份额净值	1.2938
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	29.38%

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

南方大数据 300 指数 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	4.70%	0.89%	4.38%	0.92%	0.32%	-0.03%
过去三个月	0.60%	0.91%	-0.43%	0.93%	1.03%	-0.02%
过去六个月	9.15%	0.85%	8.40%	0.87%	0.75%	-0.02%
过去一年	-8.34%	0.95%	-10.68%	0.98%	2.34%	-0.03%
过去三年	12.84%	1.18%	-4.16%	1.19%	17.00%	-0.01%

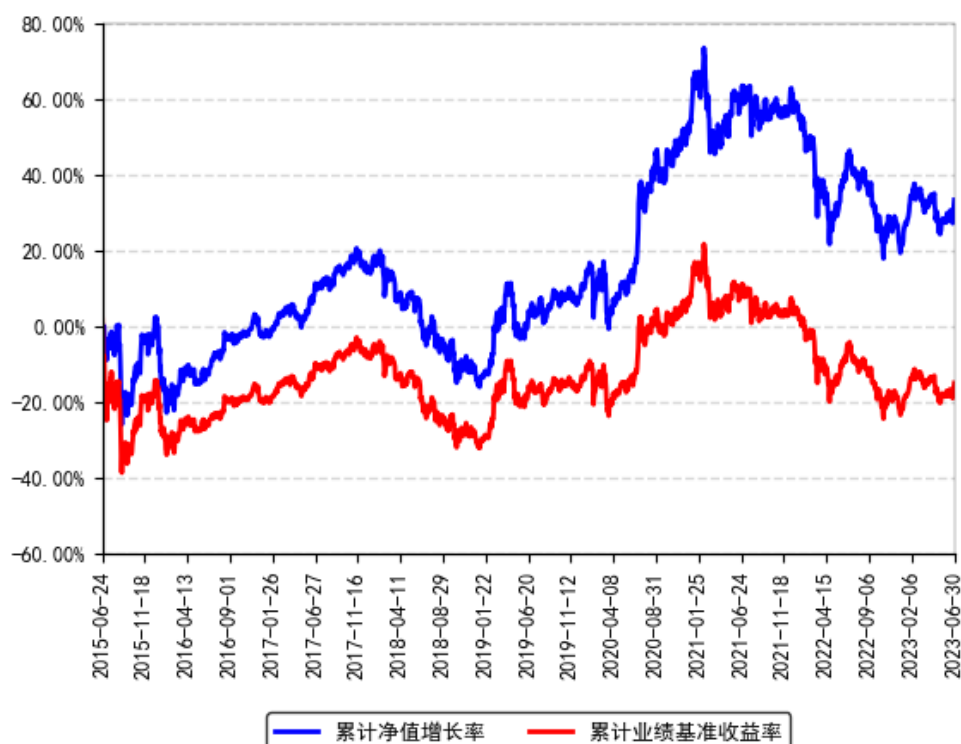
自基金合同生效起至今	33.31%	1.27%	-15.05%	1.34%	48.36%	-0.07%
------------	--------	-------	---------	-------	--------	--------

南方大数据 300 指数 C

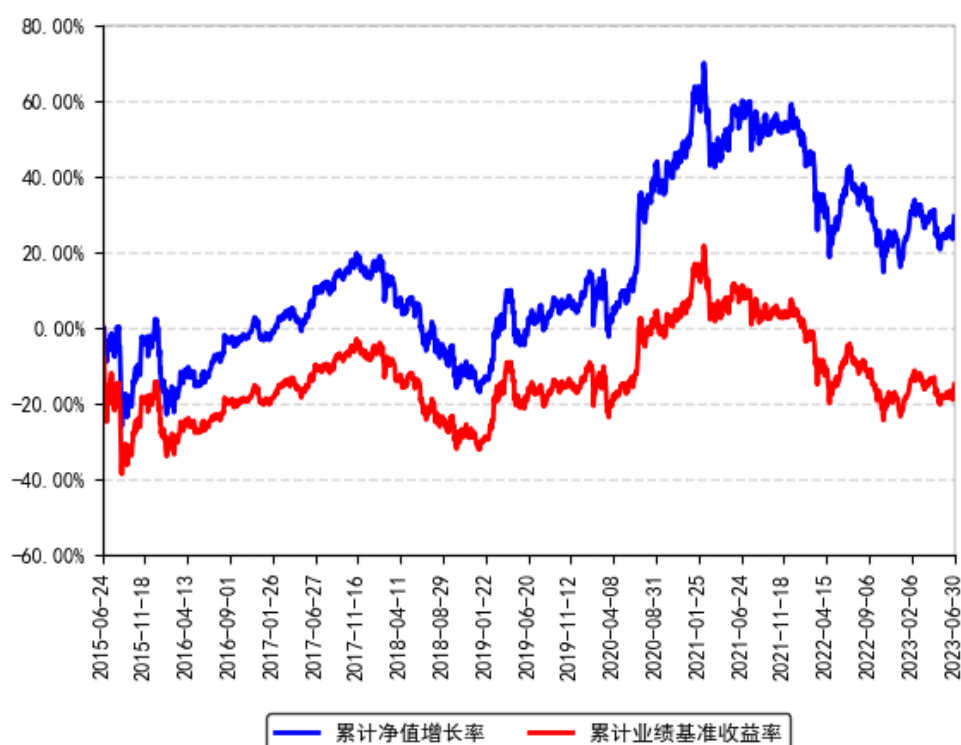
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	4.67%	0.90%	4.38%	0.92%	0.29%	-0.02%
过去三个月	0.50%	0.91%	-0.43%	0.93%	0.93%	-0.02%
过去六个月	8.91%	0.85%	8.40%	0.87%	0.51%	-0.02%
过去一年	-8.71%	0.95%	-10.68%	0.98%	1.97%	-0.03%
过去三年	11.49%	1.17%	-4.16%	1.19%	15.65%	-0.02%
自基金合同生效起至今	29.38%	1.27%	-15.05%	1.34%	44.43%	-0.07%

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

南方大数据300指数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



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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

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

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，本基金投资以跟踪大数据 300 指数为主，期间我们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。

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 1.3331 元，报告期内，份额净值增长率为 9.15%，同期业绩基准增长率为 8.40%；本基金 C 份额净值为 1.2938 元，报告期内，份额净值增长率为 8.91%，同期业绩基准增长率为 8.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，国内经济具备复苏空间，但信用扩张政策节制的情况下，需要更多耐心。美国经济或已现硬着陆前兆，下半年失业率或明显抬升，衰退风险未解除，降息预期有望重燃。在上述宏观条件组合的情况下，我们认为 A 股仍具备投资价值，结构或偏向小盘和低估值风格。本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度，力求实现对标的指数的有效跟踪。

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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了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,本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方大数据 300 指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	16,425,646.88	12,196,067.79
结算备付金		1,485,138.85	1,948,733.37
存出保证金		10,635.84	11,630.30

交易性金融资产	6.4.3.2	204,140,177.22	190,447,672.76
其中：股票投资		204,016,763.43	190,145,246.24
基金投资		-	-
债券投资		123,413.79	302,426.52
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		192,702.56	124,200.39
应收股利		-	-
应收申购款		55,652.33	50,105.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		222,309,953.68	204,778,409.94
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		151,383.22	19,827.57
应付管理人报酬		87,924.24	88,081.30
应付托管费		26,377.26	26,424.41
应付销售服务费		11,345.42	11,146.75
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.38	1.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	1,542,942.29	1,393,583.15
负债合计		1,819,972.81	1,539,064.20
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	166,214,505.20	167,138,230.17
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	54,275,475.67	36,101,115.57

净资产合计		220,489,980.87	203,239,345.74
负债和净资产总计		222,309,953.68	204,778,409.94

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，南方大数据 300 指数 A 份额净值 1.3331 元，基金份额总额 138,599,207.82 份；南方大数据 300 指数 C 份额净值 1.2938 元，基金份额总额 27,615,297.38 份；总份额合计 166,214,505.20 份。

6.2 利润表

会计主体：南方大数据 300 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		19,396,148.24	-21,424,540.23
1.利息收入		32,279.17	39,781.77
其中：存款利息收入	6.4.3.9	32,279.17	37,841.80
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	1,939.97
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,035,753.13	-45,780,980.94
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-3,658,825.80	-46,845,462.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	315,865.48	212,975.35
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	-	-1,230,940.35
股利收益	6.4.3.13	1,307,207.19	2,082,446.40
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	21,371,215.17	24,298,837.67
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	28,407.03	17,821.27
减：二、营业总支出		952,766.15	1,025,086.01
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	537,958.38	587,959.49
2.托管费	6.4.6.2.2	161,387.47	176,387.84
3.销售服务费	6.4.6.2.3	68,153.08	75,443.38
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		0.90	7.09
8.其他费用	6.4.3.16	185,266.32	185,288.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,443,382.09	-22,449,626.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,443,382.09	-22,449,626.24
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		18,443,382.09	-22,449,626.24

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方大数据 300 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	167,138,230.17	-	36,101,115.57	203,239,345.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	167,138,230.17	-	36,101,115.57	203,239,345.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-923,724.97	-	18,174,360.10	17,250,635.13
（一）、综合收益总额	-	-	18,443,382.09	18,443,382.09

(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-923,724.97	-	-269,021.99	-1,192,746.96
其中: 1.基金申购款	10,226,601.63	-	3,104,188.26	13,330,789.89
2.基金赎回款	-11,150,326.60	-	-3,373,210.25	-14,523,536.85
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	166,214,505.20	-	54,275,475.67	220,489,980.87
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	171,061,471.50	-	99,096,579.19	270,158,050.69
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	171,061,471.50	-	99,096,579.19	270,158,050.69
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,404,072.26	-	-23,903,576.97	-27,307,649.23
(一)、综合收益总额	-	-	-22,449,626.24	-22,449,626.24
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-3,404,072.26	-	-1,453,950.73	-4,858,022.99
其中: 1.基金申购款	9,614,477.61	-	3,780,365.85	13,394,843.46
2.基金赎回款	-13,018,549.87	-	-5,234,316.58	-18,252,866.45

回款				
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	167,657,399.24	-	75,193,002.22	242,850,401.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.1.1 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	16,425,646.88

等于：本金	16,424,042.46
加：应计利息	1,604.42
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	16,425,646.88

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	192,443,757.49	-	204,016,763.43	11,573,005.94
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	123,400.00	123,413.79	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	123,400.00	123,413.79	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	192,567,157.49	13.79	204,140,177.22	11,573,005.94

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	35.57
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	101,798.65
其中：交易所市场	101,798.65
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	134,302.56
应付指数使用费	1,306,805.51
可退替代款	-
其他	-
合计	1,542,942.29

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方大数据 300 指数 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	139,996,575.71	139,996,575.71
本期申购	6,057,870.12	6,057,870.12
本期赎回（以“-”号填列）	-7,455,238.01	-7,455,238.01
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	138,599,207.82	138,599,207.82

南方大数据 300 指数 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	27,141,654.46	27,141,654.46
本期申购	4,168,731.51	4,168,731.51
本期赎回（以“-”号填列）	-3,695,088.59	-3,695,088.59

基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	27,615,297.38	27,615,297.38

注：

1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

南方大数据 300 指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	60,997,326.55	-29,995,473.03	31,001,853.52
本期利润	-2,333,835.73	17,912,381.41	15,578,545.68
本期基金份额交易产生的变动数	-658,708.53	239,078.40	-419,630.13
其中：基金申购款	2,822,199.86	-917,324.89	1,904,874.97
基金赎回款	-3,480,908.39	1,156,403.29	-2,324,505.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	58,004,782.29	-11,844,013.22	46,160,769.07

南方大数据 300 指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,801,668.18	-5,702,406.13	5,099,262.05
本期利润	-593,997.35	3,458,833.76	2,864,836.41
本期基金份额交易产生的变动数	253,317.43	-102,709.29	150,608.14
其中：基金申购款	1,835,521.43	-636,208.14	1,199,313.29
基金赎回款	-1,582,204.00	533,498.85	-1,048,705.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,460,988.26	-2,346,281.66	8,114,706.60

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	27,045.64
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	5,125.97
其他	107.56
合计	32,279.17

6.4.3.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	343,625,281.50
减：卖出股票成本总额	346,701,255.07
减：交易费用	582,852.23
买卖股票差价收入	-3,658,825.80

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.11 债券投资收益

6.4.3.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	234.85
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	315,630.63
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	315,865.48

6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,563,247.98
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,247,300.00
减：应计利息总额	254.94
减：交易费用	62.41
买卖债券差价收入	315,630.63

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.3.12 衍生工具收益

6.4.3.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.3.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.3.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

股票投资产生的股利收益	1,307,207.19
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	1,307,207.19

6.4.3.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	21,371,215.17
——股票投资	21,371,215.17
——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	21,371,215.17

6.4.3.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	26,944.84
基金转换费收入	1,462.19
合计	28,407.03

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
银行费用	963.76
合计	185,266.32

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	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、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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	314,031,059.27	46.34%	155,654,607.76	52.25%

6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交	成交金额	占当期债券成交

		总额的比例		总额的比例
华泰证券	424,598.58	27.16%	21,186,752.90	99.99%

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 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	31,403.19	17.01%	17,739.29	17.43%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	15,567.29	20.74%	12,052.60	22.38%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	537,958.38	587,959.49
其中：支付销售机构的客户维护费	194,491.06	209,973.28

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

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	161,387.47	176,387.84

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方大数据 300 指数 A	南方大数据 300 指数 C	合计
华泰证券	-	623.22	623.22
南方基金	-	5,286.88	5,286.88
兴业证券	-	13.38	13.38
合计	-	5,923.48	5,923.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方大数据 300 指数 A	南方大数据 300 指数 C	合计
华泰证券	-	669.61	669.61
南方基金	-	5,950.07	5,950.07
兴业证券	-	14.43	14.43
合计	-	6,634.11	6,634.11

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	16,425,646.88	27,045.64	18,883,058.57	17,396.75

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	688472	阿特斯	网下申购	8,903	98,823.30
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	2,488	80,909.76
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	3,496	73,136.32
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	2,535	48,672.00
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券	127083	山路转债	配债	3,770	377,000.00
兴业证券	301322	绿通科技	网下申购	673	88,237.03
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	1,944	62,771.76
兴业证券	113670	金 23 转债	配债	510	51,000.00
兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	网下申购	25,115	142,904.35

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	6,745	151,964.85
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	1,594	128,795.20
华泰联合	110085	通 22 转债	配债	1,070	107,000.00

华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	1,630	92,714.40
华泰联合	113055	成银转债	配债	670	67,000.00
兴业证券	600030	中信证券	配股	20,850	300,865.50

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新股未上市	57.66	57.66	1,358	78,302.28	78,302.28	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新股未上市	39.78	39.78	1,615	64,244.70	64,244.70	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定期	39.78	39.78	180	7,160.40	7,160.40	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新股未上市	55.00	55.00	1,078	59,290.00	59,290.00	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内（含）	新股未上市	36.90	36.90	1,466	54,095.40	54,095.40	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内（含）	新股未上市	25.82	25.82	1,724	44,513.68	44,513.68	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁定期	25.82	25.82	192	4,957.44	4,957.44	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-

688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	19.86	18.06	1,321	26,235.06	23,857.26	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股锁 定期	29.60	71.42	220	6,512.00	15,712.40	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	11.10	17.04	891	9,890.10	15,182.64	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	5.69	5.41	2,512	14,293.28	13,589.92	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	23.60	64.67	206	4,861.60	13,322.02	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	20.67	26.17	507	10,479.69	13,268.19	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	13.06	20.62	616	8,044.96	12,701.92	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	76.80	107.9 5	114	8,755.20	12,306.30	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	23.77	42.89	275	6,536.75	11,794.75	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	37.88	29.49	399	15,114.12	11,766.51	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	9.26	18.59	599	5,546.74	11,135.41	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	32.52	42.37	249	8,097.48	10,550.13	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	30.85	23.63	432	13,327.20	10,208.16	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	32.29	51.12	195	6,296.55	9,968.40	-
688576	西山科技	2023 年 5 月	6 个月	新股锁 定期	135.8 0	120.4 1	80	10,864.00	9,632.80	-

		30 日								
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	152.3 8	135.9 7	70	10,666.60	9,517.90	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	12.68	22.31	412	5,224.16	9,191.72	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	26.74	40.68	225	6,016.50	9,153.00	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	23.80	32.84	271	6,449.80	8,899.64	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	10.68	12.34	652	6,963.36	8,045.68	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	36.15	38.13	211	7,627.65	8,045.43	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
688352	硕中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	12.10	12.07	638	7,719.80	7,700.66	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	75.00	90.76	84	6,300.00	7,623.84	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	14.16	16.21	443	6,272.88	7,181.03	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	43.67	53.05	134	5,851.78	7,108.70	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	35.00	51.23	132	4,620.00	6,762.36	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	20.92	19.16	350	7,322.00	6,706.00	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	30.26	25.33	262	7,928.12	6,636.46	-
301355	南王科技	2023	6 个月	新股锁	17.55	16.75	393	6,897.15	6,582.75	-

		年 6 月 2 日		定期						
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	19.20	25.53	254	4,876.80	6,484.62	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁 定期	26.66	31.50	200	5,332.00	6,300.00	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	50.00	48.39	130	6,500.00	6,290.70	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	11.88	21.02	297	3,528.36	6,242.94	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	33.73	31.85	194	6,543.62	6,178.90	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	72.50	58.42	99	7,177.50	5,783.58	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	26.35	30.60	189	4,980.15	5,783.40	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	46.13	34.40	165	7,611.45	5,676.00	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	24.66	22.51	252	6,214.32	5,672.52	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	19.99	16.90	326	6,516.74	5,509.40	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	131.1 1	53.24	68	8,915.48	3,620.32	-
301322	绿通科技	2023 年 5 月 25 日	1-6 个 月（含）	锁定期 转增	-	53.24	34	-	1,810.16	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	56.50	52.93	102	5,763.00	5,398.86	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	6.58	7.58	703	4,625.74	5,328.74	-

301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	32.60	30.37	174	5,672.40	5,284.38	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	25.28	29.87	176	4,449.28	5,257.12	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	125.8 8	86.79	60	7,552.80	5,207.40	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	39.06	39.36	129	5,038.74	5,077.44	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	33.99	29.49	153	5,200.47	4,511.97	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	73.45	46.64	90	6,610.50	4,197.60	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	11.66	12.26	230	2,681.80	2,819.80	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	10.36	11.84	237	2,455.32	2,806.08	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	20.68	25.49	97	2,005.96	2,472.53	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	25.98	24.53	76	1,974.48	1,864.28	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	15.38	14.87	123	1,891.74	1,829.01	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	44.48	39.48	43	1,912.64	1,697.64	-

6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

证券代	证券名称	成功认	受限期	流通受	认购	期末	数量	期末成本总	期末估值总	备
-----	------	-----	-----	-----	----	----	----	-------	-------	---

码		购日		限类型	价格	估值 单价	(单位 张)	额	额	注
127087	星帅转 2	2023 年 6 月 14 日	1-6 个 月(含)	配债未 上市	100.0 0	100.0 1	1,234	123,400.00	123,413.79	-

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股票 名称	停牌日期	停牌 原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌开 盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000691	亚太 实业	2023 年 6 月 27 日	重大 事项 停牌	4.36	2023 年 7 月 4 日	4.80	129,600	545,646.32	565,056.00	-

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

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。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。但在因特殊情况下，本基金将配合使用优化方法作为补充，以保证对标的指数的有效跟踪。

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

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

6.4.9.3 流动性风险

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

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

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的投资股指期货,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。

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,如根据基金合同的规定,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,425,646.88	-	-	-	16,425,646.88
结算备付金	1,485,138.85	-	-	-	1,485,138.85
存出保证金	10,635.84	-	-	-	10,635.84
交易性金融资产	-	-	123,413.79	204,016,763.43	204,140,177.22
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	-	-	-	192,702.56	192,702.56
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	55,652.33	55,652.33
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,921,421.57	-	123,413.79	204,265,118.32	222,309,953.68
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	-	-	-	151,383.22	151,383.22
应付管理人报酬	-	-	-	87,924.24	87,924.24
应付托管费	-	-	-	26,377.26	26,377.26
应付销售服务费	-	-	-	11,345.42	11,345.42
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.38	0.38
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,542,942.29	1,542,942.29
负债总计	-	-	-	1,819,972.81	1,819,972.81
利率敏感度缺口	17,921,421.57	-	123,413.79	202,445,145.51	220,489,980.87
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,196,067.79	-	-	-	12,196,067.79
结算备付金	1,948,733.37	-	-	-	1,948,733.37
存出保证金	11,630.30	-	-	-	11,630.30
交易性金融资产	-	-	302,426.52	190,145,246.24	190,447,672.76
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	-	-	-	124,200.39	124,200.39
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	50,105.33	50,105.33

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,156,431.46	-	302,426.52	190,319,551.96	204,778,409.94
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	-	-	-	19,827.57	19,827.57
应付管理人报酬	-	-	-	88,081.30	88,081.30
应付托管费	-	-	-	26,424.41	26,424.41
应付销售服务费	-	-	-	11,146.75	11,146.75
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.02	1.02
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,393,583.15	1,393,583.15
负债总计	-	-	-	1,539,064.20	1,539,064.20
利率敏感度缺口	14,156,431.46	-	302,426.52	188,780,487.76	203,239,345.74

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-1,733.95	-4,309.31
	2.市场利率平行下降 25 个基点	1,763.16	4,382.83

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 80% 以上的基金资产投资于股票（含存托凭证）；本基金投资于大数据 300 指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 85%，且不低于非现金基金资产的 80%，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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	204,016,763.43	92.53	190,145,246.24	93.56
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	204,016,763.43	92.53	190,145,246.24	93.56

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(2023 年 6 月 30 日)	上年度末(2022 年 12 月 31 日)
1.组合自身基准上升 5%	10,623,279.71	9,924,405.83
2.组合自身基准下降 5%	-10,623,279.71	-9,924,405.83

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	202,668,481.38
第二层次	1,001,033.69
第三层次	470,662.15
合计	204,140,177.22

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	204,016,763.43	91.77
	其中：股票	204,016,763.43	91.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	123,413.79	0.06
	其中：债券	123,413.79	0.06
	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	17,910,785.73	8.06
8	其他资产	258,990.73	0.12
9	合计	222,309,953.68	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	2,007,756.00	0.91
B	采矿业	917,850.00	0.42
C	制造业	150,983,087.66	68.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,969,016.67	2.71
E	建筑业	7,077,540.80	3.21
F	批发和零售业	12,223,592.20	5.54
G	交通运输、仓储和邮政业	3,776,072.70	1.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,284,792.03	1.49
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,454,140.40	2.47
L	租赁和商务服务业	1,575,284.00	0.71
M	科学研究和技术服务业	2,509,602.37	1.14
N	水利、环境和公共设施管理业	4,991,876.20	2.26
O	居民服务、修理和其他服务业	440,059.00	0.20
P	教育	1,073,588.00	0.49
Q	卫生和社会工作	15,712.40	0.01

R	文化、体育和娱乐业	1,183,364.00	0.54
S	综合	533,429.00	0.24
	合计	204,016,763.43	92.53

7.2.2 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

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	300779	惠城环保	36,900	1,966,401.00	0.89
2	002588	史丹利	291,200	1,770,496.00	0.80
3	002448	中原内配	241,600	1,691,200.00	0.77
4	688526	科前生物	63,698	1,515,375.42	0.69
5	003006	百亚股份	82,700	1,429,056.00	0.65
6	300304	云意电气	257,000	1,423,780.00	0.65
7	002062	宏润建设	261,800	1,416,338.00	0.64
8	002650	加加食品	349,500	1,380,525.00	0.63
9	601010	文峰股份	559,300	1,370,285.00	0.62
10	002337	赛象科技	195,500	1,305,940.00	0.59
11	300667	必创科技	66,300	1,305,447.00	0.59
12	300729	乐歌股份	70,980	1,266,283.20	0.57
13	002880	卫光生物	33,000	1,244,100.00	0.56
14	600628	新世界	171,900	1,242,837.00	0.56
15	300622	博士眼镜	50,600	1,194,160.00	0.54
16	002355	兴民智通	241,400	1,182,860.00	0.54
17	603158	腾龙股份	153,500	1,175,810.00	0.53
18	000558	莱茵体育	386,800	1,172,004.00	0.53
19	688190	云路股份	16,032	1,170,336.00	0.53
20	002565	顺灏股份	385,600	1,149,088.00	0.52
21	688510	航亚科技	57,569	1,145,047.41	0.52
22	600292	远达环保	195,900	1,142,097.00	0.52
23	600822	上海物贸	82,900	1,131,585.00	0.51
24	002860	星帅尔	81,800	1,102,664.00	0.50
25	688257	新锐股份	41,122	1,090,144.22	0.49
26	300982	苏文电能	18,000	1,090,080.00	0.49
27	605066	天正电气	114,800	1,080,268.00	0.49
28	000554	泰山石油	191,200	1,076,456.00	0.49
29	002659	凯文教育	224,600	1,073,588.00	0.49
30	300335	迪森股份	191,600	1,069,128.00	0.48
31	688551	科威尔	16,142	1,058,592.36	0.48
32	688665	四方光电	11,076	1,031,397.12	0.47

33	600903	贵州燃气	117,400	1,015,510.00	0.46
34	600469	风神股份	157,600	1,014,944.00	0.46
35	002613	北玻股份	216,700	1,003,321.00	0.46
36	688071	华依科技	16,324	998,212.60	0.45
37	000524	岭南控股	92,900	994,959.00	0.45
38	600683	京投发展	164,000	993,840.00	0.45
39	002381	双箭股份	128,100	988,932.00	0.45
40	301168	通灵股份	15,800	984,340.00	0.45
41	300127	银河磁体	54,226	983,117.38	0.45
42	300100	双林股份	105,800	981,824.00	0.45
43	300086	康芝药业	159,400	980,310.00	0.44
44	000014	沙河股份	85,100	973,544.00	0.44
45	002708	光洋股份	125,300	959,798.00	0.44
46	688533	上声电子	20,496	957,778.08	0.43
47	603199	九华旅游	27,600	953,580.00	0.43
48	603628	清源股份	59,800	946,634.00	0.43
49	002843	泰嘉股份	45,100	945,296.00	0.43
50	003011	海象新材	29,200	941,700.00	0.43
51	002749	国光股份	83,022	940,639.26	0.43
52	000533	顺钠股份	220,100	935,425.00	0.42
53	688670	金迪克	19,723	928,558.84	0.42
54	300969	恒帅股份	10,500	925,575.00	0.42
55	600397	安源煤业	316,500	917,850.00	0.42
56	002133	广宇集团	270,200	915,978.00	0.42
57	600630	龙头股份	157,400	900,328.00	0.41
58	300908	仲景食品	19,800	897,930.00	0.41
59	688799	华纳药厂	22,038	895,183.56	0.41
60	300279	和晶科技	159,900	893,841.00	0.41
61	688698	伟创电气	22,173	886,476.54	0.40
62	300265	通光线缆	85,300	885,414.00	0.40
63	000548	湖南投资	178,100	862,004.00	0.39
64	600681	百川能源	183,200	855,544.00	0.39
65	300756	金马游乐	44,600	852,752.00	0.39
66	603587	地素时尚	58,200	852,048.00	0.39
67	603040	新坐标	32,000	850,880.00	0.39
68	300615	欣天科技	47,900	847,351.00	0.38
69	603758	秦安股份	79,300	843,752.00	0.38
70	300549	优德精密	30,100	842,800.00	0.38
71	603116	红蜻蜓	132,800	841,952.00	0.38
72	002779	中坚科技	31,900	839,289.00	0.38
73	300698	万马科技	29,500	837,505.00	0.38
74	001218	丽臣实业	36,900	834,309.00	0.38
75	603551	奥普家居	64,500	833,985.00	0.38

76	002370	亚太药业	203,400	829,872.00	0.38
77	688737	中自科技	20,900	814,891.00	0.37
78	601188	龙江交通	241,600	811,776.00	0.37
79	300508	维宏股份	21,600	808,272.00	0.37
80	688580	伟思医疗	11,159	806,795.70	0.37
81	002956	西麦食品	50,580	790,565.40	0.36
82	002900	哈三联	59,100	790,167.00	0.36
83	002820	桂发祥	69,600	789,264.00	0.36
84	002357	富临运业	116,600	783,552.00	0.36
85	300839	博汇股份	58,940	783,312.60	0.36
86	002968	新大正	51,840	783,302.40	0.36
87	002817	黄山胶囊	89,700	778,596.00	0.35
88	300097	智云股份	114,700	767,343.00	0.35
89	300893	松原股份	29,700	764,181.00	0.35
90	600980	北矿科技	48,200	761,560.00	0.35
91	605167	利柏特	78,300	757,944.00	0.34
92	600847	万里股份	61,800	754,578.00	0.34
93	688358	祥生医疗	14,582	743,682.00	0.34
94	002893	京能热力	69,000	743,130.00	0.34
95	603099	长白山	57,900	742,278.00	0.34
96	603121	华培动力	82,890	738,549.90	0.33
97	300970	华绿生物	31,600	738,176.00	0.33
98	003017	大洋生物	21,900	736,935.00	0.33
99	603331	百达精工	49,700	734,566.00	0.33
100	001219	青岛食品	39,780	725,587.20	0.33
101	300588	熙菱信息	62,000	716,720.00	0.33
102	000632	三木集团	169,300	716,139.00	0.32
103	300175	朗源股份	189,300	715,554.00	0.32
104	688070	纵横股份	15,556	714,020.40	0.32
105	605100	华丰股份	40,400	712,252.00	0.32
106	600321	正源股份	424,600	709,082.00	0.32
107	603676	卫信康	51,300	708,966.00	0.32
108	002397	梦洁股份	202,800	703,716.00	0.32
109	688155	先惠技术	12,912	700,605.12	0.32
110	300997	欢乐家	48,000	699,360.00	0.32
111	603630	拉芳家化	43,700	697,889.00	0.32
112	688090	瑞松科技	18,710	690,960.30	0.31
113	300946	恒而达	18,120	688,922.40	0.31
114	603861	白云电器	71,700	688,320.00	0.31
115	300539	横河精密	46,400	687,184.00	0.31
116	300635	中达安	50,300	685,589.00	0.31
117	688310	迈得医疗	20,898	684,827.46	0.31
118	601956	东贝集团	115,600	684,352.00	0.31

119	002983	芯瑞达	27,700	683,359.00	0.31
120	603278	大业股份	60,500	674,575.00	0.31
121	300950	德固特	31,800	674,160.00	0.31
122	300694	蠡湖股份	63,200	671,816.00	0.30
123	600191	华资实业	116,800	668,096.00	0.30
124	603103	横店影视	39,600	666,864.00	0.30
125	000605	渤海股份	105,500	666,760.00	0.30
126	603586	金麒麟	41,500	662,755.00	0.30
127	605300	佳禾食品	30,400	660,896.00	0.30
128	688625	呈和科技	16,763	656,941.97	0.30
129	300971	博亚精工	25,000	656,250.00	0.30
130	600540	新赛股份	143,900	654,745.00	0.30
131	002693	双成药业	108,700	654,374.00	0.30
132	300599	雄塑科技	78,900	649,347.00	0.29
133	000759	中百集团	143,900	648,989.00	0.29
134	002973	侨银股份	55,600	644,960.00	0.29
135	603689	皖天然气	73,100	641,087.00	0.29
136	300154	瑞凌股份	80,000	640,800.00	0.29
137	300611	美力科技	65,800	634,312.00	0.29
138	603697	有友食品	69,160	634,197.20	0.29
139	300387	富邦股份	87,100	634,088.00	0.29
140	603109	神驰机电	35,300	630,105.00	0.29
141	688021	奥福环保	24,304	629,959.68	0.29
142	300871	回盛生物	38,200	629,536.00	0.29
143	600099	林海股份	66,900	626,184.00	0.28
144	603679	华体科技	41,700	622,164.00	0.28
145	002763	汇洁股份	70,200	621,972.00	0.28
146	603798	康普顿	61,100	620,776.00	0.28
147	300753	爱朋医疗	33,700	617,721.00	0.28
148	600159	大龙地产	228,800	615,472.00	0.28
149	600506	统一股份	58,500	614,835.00	0.28
150	002494	华斯股份	132,200	612,086.00	0.28
151	603041	美思德	50,900	611,818.00	0.28
152	300945	曼卡龙	39,000	605,280.00	0.27
153	301086	鸿富瀚	11,850	600,795.00	0.27
154	603578	三星新材	41,300	600,089.00	0.27
155	688125	安达智能	11,039	599,969.65	0.27
156	603683	晶华新材	51,500	595,855.00	0.27
157	603856	东宏股份	45,100	594,869.00	0.27
158	300155	安居宝	117,800	593,712.00	0.27
159	002395	双象股份	50,500	590,850.00	0.27
160	002969	嘉美包装	150,200	587,282.00	0.27
161	300697	电工合金	48,600	582,228.00	0.26

162	603390	通达电气	69,300	582,120.00	0.26
163	688529	豪森股份	22,244	581,013.28	0.26
164	600287	江苏舜天	113,700	581,007.00	0.26
165	300805	电声股份	69,500	580,325.00	0.26
166	001317	三羊马	15,700	579,330.00	0.26
167	300898	熊猫乳品	25,700	575,166.00	0.26
168	600693	东百集团	146,300	574,959.00	0.26
169	603789	星光农机	59,700	574,314.00	0.26
170	002775	文科园林	152,000	570,000.00	0.26
171	002998	优彩资源	80,200	569,420.00	0.26
172	601279	英利汽车	102,400	567,296.00	0.26
173	603101	汇嘉时代	92,600	566,712.00	0.26
174	688793	倍轻松	10,500	565,950.00	0.26
175	300937	药易购	17,800	565,862.00	0.26
176	000691	亚太实业	129,600	565,056.00	0.26
177	300836	佰奥智能	18,800	561,744.00	0.25
178	605287	德才股份	23,700	561,690.00	0.25
179	300405	科隆股份	102,500	560,675.00	0.25
180	301199	迈赫股份	17,600	560,384.00	0.25
181	600156	华升股份	126,500	556,600.00	0.25
182	300665	飞鹿股份	64,000	556,160.00	0.25
183	003023	彩虹集团	27,100	555,821.00	0.25
184	688314	康拓医疗	14,767	552,876.48	0.25
185	603768	常青股份	31,000	550,870.00	0.25
186	603488	展鹏科技	68,500	550,055.00	0.25
187	688669	聚石化学	30,317	549,647.21	0.25
188	600302	标准股份	104,200	549,134.00	0.25
189	605158	华达新材	72,000	547,200.00	0.25
190	002809	红墙股份	50,600	546,480.00	0.25
191	002513	蓝丰生化	94,700	544,525.00	0.25
192	601798	蓝科高新	71,600	543,444.00	0.25
193	301098	金埔园林	45,000	542,250.00	0.25
194	000017	深中华 A	125,400	541,728.00	0.25
195	000609	中迪投资	110,900	533,429.00	0.24
196	603725	天安新材	65,500	532,515.00	0.24
197	301066	万事利	30,800	530,992.00	0.24
198	003008	开普检测	18,400	528,632.00	0.24
199	002963	豪尔赛	36,300	528,165.00	0.24
200	603090	宏盛股份	23,600	525,100.00	0.24
201	603161	科华控股	35,900	523,063.00	0.24
202	002976	瑞玛精密	18,700	523,039.00	0.24
203	600593	大连圣亚	31,900	522,522.00	0.24
204	603038	华立股份	59,300	521,840.00	0.24

205	301076	新潮新材	26,400	517,968.00	0.23
206	002905	金逸影视	50,000	516,500.00	0.23
207	300813	泰林生物	17,890	511,117.30	0.23
208	003003	天元股份	48,300	511,014.00	0.23
209	600883	博闻科技	66,900	507,771.00	0.23
210	688038	中科通达	33,742	504,780.32	0.23
211	300881	盛德鑫泰	15,290	503,805.50	0.23
212	300838	浙江力诺	27,500	502,425.00	0.23
213	688335	复洁环保	20,453	501,916.62	0.23
214	688288	鸿泉物联	19,710	501,028.20	0.23
215	688718	唯赛勃	28,693	496,675.83	0.23
216	301065	本立科技	24,000	496,560.00	0.23
217	300210	森远股份	159,900	492,492.00	0.22
218	301092	争光股份	18,800	492,184.00	0.22
219	605050	福然德	39,800	491,530.00	0.22
220	603511	爱慕股份	28,558	491,197.60	0.22
221	300843	胜蓝股份	22,900	488,457.00	0.22
222	600689	上海三毛	52,100	487,135.00	0.22
223	300509	新美星	64,000	483,200.00	0.22
224	603286	日盈电子	24,400	481,900.00	0.22
225	300878	维康药业	21,100	478,970.00	0.22
226	301133	金钟股份	18,000	478,080.00	0.22
227	002333	罗普斯金	78,900	477,345.00	0.22
228	300262	巴安水务	179,400	477,204.00	0.22
229	600250	南纺股份	76,700	476,307.00	0.22
230	603321	梅轮电梯	61,100	475,969.00	0.22
231	301020	密封科技	21,000	474,810.00	0.22
232	001210	金房能源	21,120	474,355.20	0.22
233	603706	东方环宇	31,100	468,055.00	0.21
234	603828	柯利达	156,600	466,668.00	0.21
235	300877	金春股份	26,400	465,696.00	0.21
236	603022	新通联	49,000	461,090.00	0.21
237	688395	正弦电气	17,291	459,767.69	0.21
238	600828	茂业商业	123,000	455,100.00	0.21
239	002890	弘宇股份	30,520	450,780.40	0.20
240	300864	南大环境	20,500	450,590.00	0.20
241	688081	兴图新科	23,475	450,015.75	0.20
242	688051	佳华科技	12,586	442,146.18	0.20
243	603316	诚邦股份	72,000	442,080.00	0.20
244	300736	百邦科技	36,100	440,059.00	0.20
245	603949	雪龙集团	27,700	437,106.00	0.20
246	603696	安记食品	46,100	435,184.00	0.20
247	688379	华光新材	21,262	431,831.22	0.20

248	688611	杭州柯林	10,023	429,485.55	0.19
249	301063	海锅股份	15,400	429,044.00	0.19
250	603615	茶花股份	45,400	428,576.00	0.19
251	605319	无锡振华	26,700	423,729.00	0.19
252	300907	康平科技	19,400	416,518.00	0.19
253	688013	天臣医疗	17,493	414,759.03	0.19
254	688092	爱科科技	13,766	411,190.42	0.19
255	002989	中天精装	25,100	409,130.00	0.19
256	301057	汇隆新材	23,400	403,416.00	0.18
257	605268	王力安防	39,200	401,016.00	0.18
258	605288	凯迪股份	9,300	400,272.00	0.18
259	688309	恒誉环保	18,840	391,495.20	0.18
260	300717	华信新材	22,900	390,445.00	0.18
261	301111	粤万年青	19,900	389,642.00	0.18
262	688109	品茗科技	14,831	384,122.90	0.17
263	301119	正强股份	14,430	383,838.00	0.17
264	601086	国芳集团	85,600	380,920.00	0.17
265	300851	交大思诺	14,100	379,854.00	0.17
266	300897	山科智能	10,800	369,576.00	0.17
267	603102	百合股份	8,500	367,115.00	0.17
268	301116	益客食品	23,800	366,520.00	0.17
269	002811	郑中设计	46,200	366,366.00	0.17
270	300927	江天化学	22,200	363,414.00	0.16
271	300906	日月明	14,400	361,728.00	0.16
272	000020	深华发 A	31,100	359,827.00	0.16
273	001209	洪兴股份	19,800	352,638.00	0.16
274	301009	可靠股份	30,200	351,226.00	0.16
275	605179	一鸣食品	32,200	350,336.00	0.16
276	002898	赛隆药业	30,900	349,788.00	0.16
277	605303	园林股份	31,500	349,650.00	0.16
278	603139	康惠制药	21,300	348,894.00	0.16
279	301186	超达装备	9,700	347,842.00	0.16
280	603900	莱绅通灵	54,900	344,772.00	0.16
281	688215	瑞晟智能	8,567	337,882.48	0.15
282	605033	美邦股份	17,900	334,730.00	0.15
283	002856	美芝股份	33,600	332,304.00	0.15
284	301229	纽泰格	10,600	325,420.00	0.15
285	300819	聚杰微纤	23,250	318,757.50	0.14
286	603499	翔港科技	32,700	311,958.00	0.14
287	300984	金沃股份	11,800	309,514.00	0.14
288	301043	绿岛风	9,600	306,912.00	0.14
289	002718	友邦吊顶	19,700	298,652.00	0.14
290	603958	哈森股份	38,900	298,363.00	0.14

291	001296	长江材料	14,100	296,241.00	0.13
292	603536	惠发食品	46,000	296,240.00	0.13
293	301130	西点药业	10,700	294,036.00	0.13
294	605255	天普股份	17,700	279,660.00	0.13
295	605188	国光连锁	31,900	274,978.00	0.12
296	300844	山水比德	8,500	247,690.00	0.11
297	001202	炬申股份	15,900	234,684.00	0.11
298	603606	东方电缆	4,500	220,635.00	0.10
299	600584	长电科技	6,900	215,073.00	0.10
300	688981	中芯国际	4,233	213,851.16	0.10
301	301024	霍普股份	8,400	213,780.00	0.10
302	605198	安德利	10,500	203,805.00	0.09
303	603709	中源家居	10,700	194,098.00	0.09
304	688443	智翔金泰	3,986	122,640.68	0.06
305	301280	珠城科技	2,421	86,574.96	0.04
306	301379	天山电子	3,040	84,907.20	0.04
307	301486	致尚科技	1,358	78,302.28	0.04
308	688426	康为世纪	2,525	76,255.00	0.03
309	301356	天振股份	3,310	72,489.00	0.03
310	301488	豪恩汽电	1,795	71,405.10	0.03
311	301223	中荣股份	3,768	70,536.96	0.03
312	301365	矩阵股份	4,179	68,786.34	0.03
313	688175	高凌信息	2,017	66,803.04	0.03
314	301232	飞沃科技	986	59,615.61	0.03
315	688603	天承科技	1,078	59,290.00	0.03
316	301203	国泰环保	1,645	58,645.20	0.03
317	301261	恒工精密	1,466	54,095.40	0.02
318	688623	双元科技	592	54,082.24	0.02
319	301202	朗威股份	1,916	49,471.12	0.02
320	301345	涛涛车业	895	42,604.15	0.02
321	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
322	688249	晶合集成	1,321	23,857.26	0.01
323	301293	三博脑科	220	15,712.40	0.01
324	688472	阿特斯	891	15,182.64	0.01
325	688469	中芯集成	2,512	13,589.92	0.01
326	688361	中科飞测	206	13,322.02	0.01
327	301317	鑫磊股份	507	13,268.19	0.01
328	603162	海通发展	774	13,196.70	0.01
329	301320	豪江智能	616	12,701.92	0.01
330	301325	曼恩斯特	114	12,306.30	0.01
331	301358	湖南裕能	275	11,794.75	0.01
332	688629	华丰科技	599	11,135.41	0.01
333	688478	晶升股份	249	10,550.13	0.00

334	301260	格力博	432	10,208.16	0.00
335	301315	威士顿	195	9,968.40	0.00
336	688576	西山科技	80	9,632.80	0.00
337	688531	日联科技	70	9,517.90	0.00
338	688562	航天软件	412	9,191.72	0.00
339	688582	芯动联科	225	9,153.00	0.00
340	301382	蜂助手	271	8,899.64	0.00
341	688620	安凯微	652	8,045.68	0.00
342	688146	中船特气	211	8,045.43	0.00
343	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
344	688352	颀中科技	638	7,700.66	0.00
345	688458	美芯晟	84	7,623.84	0.00
346	688334	西高院	443	7,181.03	0.00
347	688543	国科军工	134	7,108.70	0.00
348	688535	华海诚科	132	6,762.36	0.00
349	688512	慧智微	350	6,706.00	0.00
350	688570	天玛智控	262	6,636.46	0.00
351	301355	南王科技	393	6,582.75	0.00
352	688429	时创能源	254	6,484.62	0.00
353	688433	华曙高科	200	6,300.00	0.00
354	301357	北方长龙	130	6,290.70	0.00
355	001287	中电港	297	6,242.94	0.00
356	301373	凌玮科技	194	6,178.90	0.00
357	301428	世纪恒通	189	5,783.40	0.00
358	301376	致欧科技	252	5,672.52	0.00
359	301439	泓淋电力	326	5,509.40	0.00
360	301322	绿通科技	102	5,430.48	0.00
361	301157	华塑科技	102	5,398.86	0.00
362	601061	中信金属	703	5,328.74	0.00
363	301337	亚华电子	174	5,284.38	0.00
364	688631	莱斯信息	176	5,257.12	0.00
365	301323	新莱福	129	5,077.44	0.00
366	688479	友车科技	153	4,511.97	0.00
367	601133	柏诚股份	230	2,819.80	0.00
368	601065	江盐集团	237	2,806.08	0.00
369	001328	登康口腔	97	2,472.53	0.00
370	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
371	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
372	603125	常青科技	76	1,864.28	0.00
373	001360	南矿集团	123	1,829.01	0.00
374	001367	海森药业	43	1,697.64	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	002036	联创电子	2,806,448.00	1.38
2	002126	银轮股份	2,408,052.00	1.18
3	300693	盛弘股份	2,220,651.00	1.09
4	002396	星网锐捷	2,061,550.00	1.01
5	603306	华懋科技	2,034,855.20	1.00
6	603308	应流股份	1,965,924.00	0.97
7	002006	精工科技	1,941,776.00	0.96
8	300525	博思软件	1,912,070.39	0.94
9	002807	江阴银行	1,903,074.00	0.94
10	002281	光迅科技	1,879,992.00	0.93
11	002588	史丹利	1,840,257.00	0.91
12	688711	宏微科技	1,790,428.75	0.88
13	688559	海目星	1,784,548.48	0.88
14	688019	安集科技	1,731,771.25	0.85
15	300416	苏试试验	1,696,850.00	0.83
16	002458	益生股份	1,694,261.00	0.83
17	688408	中信博	1,651,172.64	0.81
18	002085	万丰奥威	1,620,674.00	0.80
19	002544	普天科技	1,597,870.00	0.79
20	688526	科前生物	1,595,550.80	0.79

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	300624	万兴科技	2,359,471.00	1.16
2	002318	久立特材	2,287,822.00	1.13
3	603876	鼎胜新材	2,273,512.00	1.12
4	300394	天孚通信	2,159,532.00	1.06
5	603300	华铁应急	2,067,914.00	1.02
6	002832	比音勒芬	1,994,373.00	0.98
7	002126	银轮股份	1,964,506.00	0.97
8	688019	安集科技	1,956,905.00	0.96
9	300693	盛弘股份	1,895,623.00	0.93
10	002807	江阴银行	1,869,339.00	0.92
11	002281	光迅科技	1,848,800.00	0.91

12	002396	星网锐捷	1,826,366.00	0.90
13	600850	电科数字	1,817,506.00	0.89
14	002036	联创电子	1,767,041.00	0.87
15	600761	安徽合力	1,744,336.00	0.86
16	300226	上海钢联	1,715,139.00	0.84
17	002458	益生股份	1,677,011.00	0.83
18	300525	博思软件	1,670,213.00	0.82
19	000913	钱江摩托	1,638,276.00	0.81
20	300910	瑞丰新材	1,605,251.00	0.79

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	339,201,557.09
卖出股票收入（成交）总额	343,625,281.50

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）	123,413.79	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	123,413.79	0.06

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	127087	星帅转 2	1,234	123,413.79	0.06

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

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

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	10,635.84
2	应收清算款	192,702.56
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	55,652.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	258,990.73

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

本基金本报告期末投资前十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
南方大数据 300 指数 A	34,729	3,990.88	59,151.68	0.04%	138,540,056 .14	99.96%
南方大数据 300 指数 C	28,073	983.70	-	-	27,615,297. 38	100.00%
合计	62,802	2,646.64	59,151.68	0.04%	166,155,353 .52	99.96%

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	南方大数据 300 指数 A	89,668.14	0.0647%
	南方大数据 300 指数 C	-	-
	合计	89,668.14	0.0539%

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	南方大数据 300 指数 A	0
	南方大数据 300 指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方大数据 300 指数 A	0~10
	南方大数据 300 指数 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方大数据 300 指数 A	南方大数据 300 指数 C
基金合同生效日(2015 年 6 月 24 日)基金份额总额	1,874,441,043.18	240,559,049.56
本报告期期初基金份额总额	139,996,575.71	27,141,654.46
本报告期基金总申购份额	6,057,870.12	4,168,731.51
减：报告期基金总赎回份额	7,455,238.01	3,695,088.59
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	138,599,207.82	27,615,297.38

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人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	
申万宏源	2	363,203,704.22	53.59%	153,020.50	82.88%	-
华泰证券	3	314,031,059.27	46.34%	31,403.19	17.01%	-
银河证券	1	495,995.82	0.07%	208.92	0.11%	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

华安证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	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：

海通证券

银泰证券

退租交易单元：

无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		交总额的 比例		额的比例
申万宏源	1,138,649.40	72.84%	-	-	-	-
华泰证券	424,598.58	27.16%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-01
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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-22
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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
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可转换公司债券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-29
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资	上海证券报、基金管	2023-04-15

	关联方承销证券的关联交易公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-20
7	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-29
8	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-10
9	南方基金关于旗下部分基金增加中国工商银行作为销售机构及开通相关业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-18
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-03
11	南方基金关于旗下部分基金增加东方证券为销售机构及开通相关业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-06
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
13	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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21

§ 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大数据 300 指数证券投资基金的文件；

- 2、《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方大数据 300 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、《南方大数据 300 指数证券投资基金 2023 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>