

南方沪深 300 交易型开放式指数证券 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	76
7.1 期末基金资产组合情况.....	76
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	76
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.....	77
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	86
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	88
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.....	88
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.....	88
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.....	88
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.....	88

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	88
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	88
7.12 投资组合报告附注.....	89
§8 基金份额持有人信息.....	90
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	90
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	90
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	91
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	91
§9 开放式基金份额变动.....	91
§10 重大事件揭示.....	91
10.1 基金份额持有人大会决议.....	91
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.....	91
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	91
10.4 基金投资策略的改变.....	92
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	92
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.....	92
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	92
10.8 其他重大事件.....	94
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	95
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.....	95
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	95
§12 备查文件目录.....	96
12.1 备查文件目录.....	96
12.2 存放地点.....	96
12.3 查阅方式.....	96

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方沪深 300ETF
场内简称	沪深 300ETF 南方
基金主代码	159925
交易代码	159925
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2013 年 2 月 18 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	835,199,451.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 4 月 11 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

传真	0755-82763889	010-66105798
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518017	100140
法定代表人	周易	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	842,600.86
本期利润	11,974,578.84
加权平均基金份额本期利润	0.0142
本期加权平均净值利润率	0.72%
本期基金份额净值增长率	0.50%
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	643,557,891.74
期末可供分配基金份额利润	0.7705
期末基金资产净值	1,596,192,088.49
期末基金份额净值	1.9112
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	80.77%

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

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

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

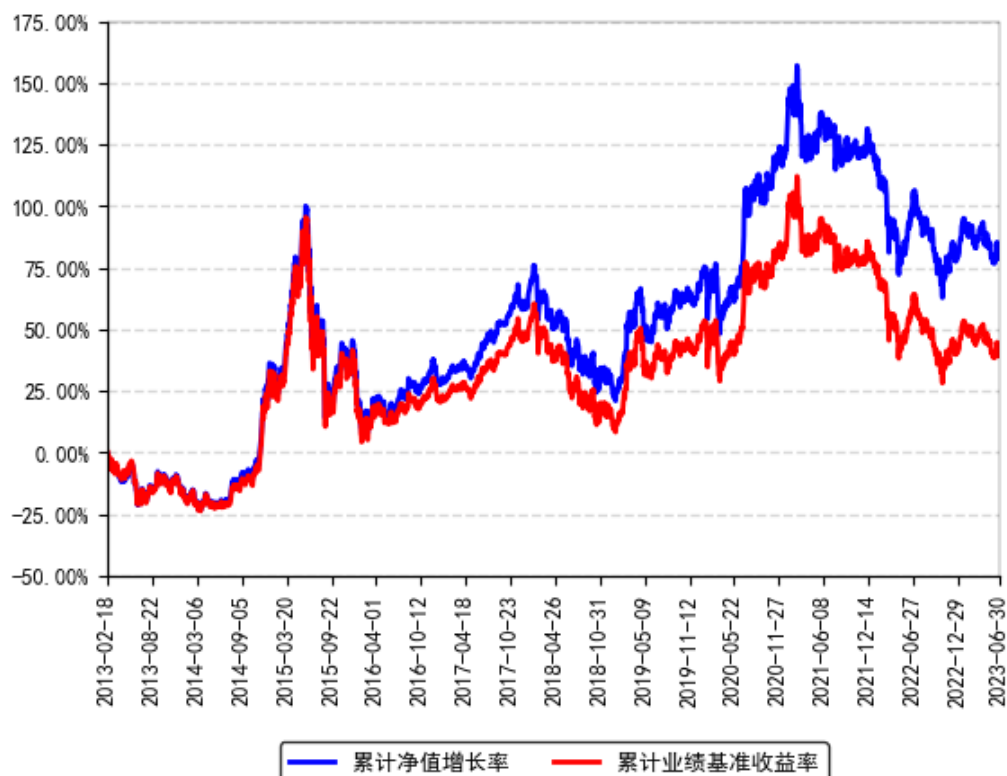
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	2.13%	0.87%	1.16%	0.87%	0.97%	0.00%
过去三个月	-3.98%	0.83%	-5.15%	0.83%	1.17%	0.00%
过去六个月	0.50%	0.84%	-0.75%	0.84%	1.25%	0.00%
过去一年	-12.25%	0.99%	-14.33%	0.99%	2.08%	0.00%
过去三年	2.09%	1.19%	-7.72%	1.20%	9.81%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	80.77%	1.40%	40.37%	1.41%	40.40%	-0.01%

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

南方沪深300ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	14	67,807,323,128.94	2013 年 04 月 22 日
	私募资产管理计划	8	2,779,034,023.98	2020 年 08 月 07 日
	其他组合	-	-	-
	合计	22	70,586,357,152.92	-

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

报告期内，沪深 300 指数下跌 0.75%。期间我们通过自建的指数化交易系统、日内择时交易模型、“跟踪误差归因分析系统、ETF 现金流精算系统等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

(1) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(3) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；

(4) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.9112 元，报告期内，份额净值增长率为 0.50%，同期业绩基准增长率为-0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年中国经济增长持续修复，权益市场整体情绪不高，呈现结构性行情。现阶段，大中华权益市场估值继续处于历史底部区域，下行空间收窄，具长期配置价值。沪深 300 作为 A 股核心宽基指数，是配置 A 股市场的重要标的。

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、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术，建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总

经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：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	4,054,105.27	2,968,593.12
结算备付金		876,744.57	316,306.43
存出保证金		320,871.01	331,200.32
交易性金融资产	6.4.3.2	1,592,217,655.31	1,658,851,963.66
其中：股票投资		1,592,217,655.31	1,658,851,963.66
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		323,279.20	207,885.43
应收股利		154,023.80	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	24,560.42	37,420.76
资产总计		1,597,971,239.58	1,662,713,369.72
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		-	-
应付管理人报酬		654,491.44	707,106.21
应付托管费		130,898.30	141,421.23
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,823.07	2,791.16
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	989,938.28	1,328,450.07
负债合计		1,779,151.09	2,179,768.67
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	952,634,196.75	995,977,256.20
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	643,557,891.74	664,556,344.85
净资产合计		1,596,192,088.49	1,660,533,601.05
负债和净资产总计		1,597,971,239.58	1,662,713,369.72

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.9112 元，基金份额总额 835,199,451.00 份。

6.2 利润表

会计主体：南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		17,290,985.41	-155,166,435.32
1.利息收入		1,081,936.19	1,837,370.41
其中：存款利息收入	6.4.3.9	10,505.74	15,578.61
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		1,071,430.45	1,821,791.80
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,141,952.68	-17,404,792.60
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-14,152,879.68	-35,266,844.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	74,721.59	968,838.82

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	-165,178.32	-686,597.54
股利收益	6.4.3.13	19,385,289.09	17,579,810.79
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	11,131,977.98	-140,016,496.04
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	-64,881.44	417,482.91
减：二、营业总支出		5,316,406.57	5,607,362.28
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	4,132,892.69	4,362,078.73
2.托管费	6.4.6.2.2	826,578.58	872,415.70
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		4,481.34	6,559.84
8.其他费用	6.4.3.16	352,453.96	366,308.01
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		11,974,578.84	-160,773,797.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		11,974,578.84	-160,773,797.60
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		11,974,578.84	-160,773,797.60

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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	995,977,256.20	-	664,556,344.85	1,660,533,601.05

资产(基金净值)				
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)	995,977,256.20	-	664,556,344.85	1,660,533,601.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-43,343,059.45	-	-20,998,453.11	-64,341,512.56
(一)、综合收益总额	-	-	11,974,578.84	11,974,578.84
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-43,343,059.45	-	-32,973,031.95	-76,316,091.40
其中: 1.基金申购款	27,374,563.90	-	19,201,500.29	46,576,064.19
2.基金赎回款	-70,717,623.35	-	-52,174,532.24	-122,892,155.59
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(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)	952,634,196.75	-	643,557,891.74	1,596,192,088.49
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)	952,634,196.68	-	1,032,069,344.20	1,984,703,540.88
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)	952,634,196.68	-	1,032,069,344.20	1,984,703,540.88

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,562,427.31	-	-169,850,146.95	-174,412,574.26
（一）、综合收益总额	-	-	-160,773,797.60	-160,773,797.60
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-4,562,427.31	-	-9,076,349.35	-13,638,776.66
其中：1.基金申购款	88,967,332.62	-	61,426,468.83	150,393,801.45
2.基金赎回款	-93,529,759.93	-	-70,502,818.18	-164,032,578.11
（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）	948,071,769.37	-	862,219,197.25	1,810,290,966.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	4,054,105.27
等于：本金	4,053,763.59
加：应计利息	341.68
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	4,054,105.27

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	1,744,642,357.70	-	1,592,217,655.31	-152,424,702.39
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	1,744,642,357.70	-	1,592,217,655.31	-152,424,702.39

注:股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,315,760.00	-	-	-
— 股指期货	2,315,760.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,315,760.00	-	-	-

6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2307	IF2307	2.00	2,298,240.00	-17,520.00
合计				-17,520.00
减: 可抵销期货暂收款				-17,520.00
净额				-

注: 1、买入持仓量以正数表示, 卖出持仓量以负数表示。

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

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 其他资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	24,560.42
待摊费用	-
可收退补款	-

应收退补款	-
合计	24,560.42

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	750,000.00
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	15,035.06
其中：交易所市场	15,035.06
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	104,138.35
应付指数使用费	120,764.87
可退替代款	-
其他	-
合计	989,938.28

注：应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	873,199,451.00	995,977,256.20
本期申购	24,000,000.00	27,374,563.90
本期赎回（以“-”号填列）	-62,000,000.00	-70,717,623.35
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	835,199,451.00	952,634,196.75

6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,415,409,080.60	-750,852,735.75	664,556,344.85
本期利润	842,600.86	11,131,977.98	11,974,578.84
本期基金份额交易产生的变动数	-61,505,943.21	28,532,911.26	-32,973,031.95

其中：基金申购款	38,840,799.70	-19,639,299.41	19,201,500.29
基金赎回款	-100,346,742.91	48,172,210.67	-52,174,532.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,354,745,738.25	-711,187,846.51	643,557,891.74

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	4,000.99
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	6,161.47
其他	343.28
合计	10,505.74

6.4.3.10 股票投资收益

6.4.3.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-9,556,210.95
股票投资收益——赎回差价收入	-4,596,668.73
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-14,152,879.68

6.4.3.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	152,151,357.07
减：卖出股票成本总额	161,506,079.33
减：交易费用	201,488.69
买卖股票差价收入	-9,556,210.95

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	122,892,155.59
减：现金支付赎回款总额	72,723,603.59
减：赎回股票成本总额	54,765,220.73
减：交易费用	-
赎回差价收入	-4,596,668.73

6.4.3.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.3.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.3.11 债券投资收益**6.4.3.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	73.71
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	74,647.88
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	74,721.59

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	453,942.02
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	379,200.00
减：应计利息总额	75.99
减：交易费用	18.15
买卖债券差价收入	74,647.88

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.3.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.3.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.3.12 衍生工具收益**6.4.3.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.3.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	-165,178.32

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	19,385,289.09
其中：证券出借权益补偿收入	667,422.19
基金投资产生的股利收益	-
合计	19,385,289.09

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	11,180,277.98
——股票投资	11,180,277.98
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-48,300.00
——权证投资	-
——期货投资	-48,300.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	11,131,977.98

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益。

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	-
替代损益	-64,881.44
合计	-64,881.44

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	247,973.61
银行费用	342.00
合计	352,453.96

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 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 35,000 元，当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，无标的指数许可使用费的收取下限。

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	137,709,623.98	53.55%	231,302,682.28	63.47%

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	453,942.02	100.00%	4,504,791.22	63.20%

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 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。

6.4.6.1.5 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	13,772.20	53.55%	11,933.54	79.37%
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	23,133.80	63.47%	22,019.30	66.16%

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	4,132,892.69	4,362,078.73

其中：支付销售机构的客户维护费	-	-
-----------------	---	---

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	826,578.58	872,415.70

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.6.2.3 销售服务费

无。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	133,207,498.00	82,896.75	11,805,315.00	4,523.64

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

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日										
关联	合约	证券	成交	交易	交易	出借	费率	利息	期末	期末

方名称	编号	名称	时间	金额	数量 (单位:)	期限 (单位:)		收入	证券 出借 业务 余额	应收 利息 余额
华泰 证券	20230 10300 00115 5	蓝思 科技	2023 年 1 月 3 日	121,9 27.00	11,30 0.00	14	3.50	161.1 2	-	-
华泰 证券	20230 10300 02772 7	贝泰 妮	2023 年 1 月 3 日	409,9 20.00	2,800. 00	14	3.50	541.7 0	-	-
华泰 证券	20230 10300 02795 9	天合 光能	2023 年 1 月 3 日	796,8 00.00	12,00 0.00	14	3.50	1,052. 95	-	-
华泰 证券	20230 10300 02796 3	中伟 股份	2023 年 1 月 3 日	294,7 12.00	4,400. 00	14	3.50	389.4 5	-	-
华泰 证券	20230 10300 03396 7	锦浪 科技	2023 年 1 月 3 日	745,0 11.00	4,100. 00	14	3.50	984.5 1	-	-
华泰 证券	20230 10900 00166 1	蓝思 科技	2023 年 1 月 9 日	223,0 27.00	21,10 0.00	28	3.50	589.4 5	-	-
华泰 证券	20230 11700 02172 3	晶盛 机电	2023 年 1 月 17 日	964,8 00.00	14,40 0.00	28	3.50	2,549. 90	-	-
华泰 证券	20230 11700 02174 9	锦浪 科技	2023 年 1 月 17 日	716,9 67.00	4,100. 00	14	3.50	947.4 5	-	-
华泰 证券	20230 11700 02175 3	天合 光能	2023 年 1 月 17 日	847,6 80.00	12,00 0.00	14	3.50	1,120. 18	-	-
华泰 证券	20230 11700 02394 7	贝泰 妮	2023 年 1 月 17 日	401,5 48.00	2,800. 00	14	3.50	530.6 3	-	-

华泰 证券	20230 11700 02487 1	卓胜 微	2023 年 1 月 17 日	941,9 90.00	7,000. 00	28	3.50	2,489. 62	-	-
华泰 证券	20230 11700 02487 5	中科 创达	2023 年 1 月 17 日	116,0 83.00	1,100. 00	28	3.50	306.8 0	-	-
华泰 证券	20230 13000 07313 7	亿纬 锂能	2023 年 1 月 30 日	105,2 04.00	1,200. 00	28	3.50	278.0 5	-	-
华泰 证券	20230 13100 00149 6	蓝思 科技	2023 年 1 月 31 日	156,8 22.00	11,80 0.00	14	3.50	207.2 4	-	-
华泰 证券	20230 13100 02694 1	贝泰 妮	2023 年 1 月 31 日	391,7 48.00	2,800. 00	14	3.50	517.6 8	-	-
华泰 证券	20230 13100 02697 1	锦浪 科技	2023 年 1 月 31 日	750,7 51.00	4,100. 00	14	3.50	992.0 9	-	-
华泰 证券	20230 13100 02766 3	天合 光能	2023 年 1 月 31 日	856,4 40.00	12,00 0.00	14	3.50	1,131. 76	-	-
华泰 证券	20230 20300 00047 0	温氏 股份	2023 年 2 月 3 日	2,376, 012.0 0	116,7 00.00	28	3.50	6,279. 64	-	-
华泰 证券	20230 20600 01438 6	蓝思 科技	2023 年 2 月 6 日	278,7 31.00	21,10 0.00	28	3.50	736.6 7	-	-
华泰 证券	20230 21000 00113 3	爱尔 眼科	2023 年 2 月 10 日	127,1 40.00	3,900. 00	28	3.50	336.0 2	-	-
华泰 证券	20230 21400 02098 1	天合 光能	2023 年 2 月 14 日	778,4 40.00	12,00 0.00	14	3.50	1,028. 68	-	-

华泰 证券	20230 21400 02657 5	贝泰 妮	2023 年 2 月 14 日	409,8 36.00	2,800. 00	14	3.50	541.5 8	-	-
华泰 证券	20230 21400 02662 1	锦浪 科技	2023 年 2 月 14 日	691,6 70.00	4,100. 00	14	3.50	914.0 2	-	-
华泰 证券	20230 21400 02791 7	中科 创达	2023 年 2 月 14 日	110,9 90.00	1,100. 00	28	3.50	293.3 4	-	-
华泰 证券	20230 21600 00085 9	泰格 医药	2023 年 2 月 16 日	1,030, 320.0 0	9,000. 00	28	3.50	2,723. 07	-	-
华泰 证券	20230 21700 00073 2	卓胜 微	2023 年 2 月 17 日	855,4 00.00	7,000. 00	14	3.50	1,130. 38	-	-
华泰 证券	20230 21700 00100 4	亿联 网络	2023 年 2 月 17 日	379,6 80.00	5,600. 00	28	3.20	917.4 6	-	-
华泰 证券	20230 22800 02505 4	天合 光能	2023 年 2 月 28 日	740,4 00.00	12,00 0.00	14	3.50	978.4 1	-	-
华泰 证券	20230 22800 02507 2	锦浪 科技	2023 年 2 月 28 日	650,9 98.00	4,100. 00	14	3.50	860.2 7	-	-
华泰 证券	20230 22800 02514 4	贝泰 妮	2023 年 2 月 28 日	387,8 00.00	2,800. 00	14	3.50	512.4 6	-	-
华泰 证券	20230 30300 00084 0	奇安 信	2023 年 3 月 3 日	82,64 3.00	1,100. 00	28	3.50	218.4 2	-	-
华泰 证券	20230 30300 01082 3	卓胜 微	2023 年 3 月 3 日	847,1 40.00	7,000. 00	14	3.50	1,119. 47	-	-

华泰 证券	20230 30300 01180 1	温氏 股份	2023 年 3 月 3 日	2,274, 483.0 0	116,7 00.00	28	3.50	6,011. 31	-	-
华泰 证券	20230 31000 00543 1	爱尔 眼科	2023 年 3 月 10 日	118,8 72.00	3,900. 00	28	3.50	314.1 7	-	-
华泰 证券	20230 31400 02157 8	锦浪 科技	2023 年 3 月 14 日	601,3 88.00	4,100. 00	14	3.50	794.7 1	-	-
华泰 证券	20230 31400 02161 4	贝泰 妮	2023 年 3 月 14 日	337,0 92.00	2,800. 00	14	3.50	445.4 6	-	-
华泰 证券	20230 31400 02502 0	天合 光能	2023 年 3 月 14 日	681,8 40.00	12,00 0.00	14	3.50	901.0 3	-	-
华泰 证券	20230 31700 00867 3	亿联 网络	2023 年 3 月 17 日	446,0 40.00	5,600. 00	28	3.20	1,077. 81	-	-
华泰 证券	20230 31700 00886 5	卓胜 微	2023 年 3 月 17 日	871,5 00.00	7,000. 00	14	3.50	1,151. 66	-	-
华泰 证券	20230 32800 00127 5	北京 君正	2023 年 3 月 28 日	98,19 6.00	1,200. 00	14	3.50	129.7 6	-	-
华泰 证券	20230 32800 02179 5	锦浪 科技	2023 年 3 月 28 日	546,5 30.00	4,100. 00	14	3.50	722.2 2	-	-
华泰 证券	20230 32800 02180 5	贝泰 妮	2023 年 3 月 28 日	335,7 20.00	2,800. 00	14	3.50	443.6 4	-	-
华泰 证券	20230 32800 02365 7	天合 光能	2023 年 3 月 28 日	614,8 80.00	12,00 0.00	14	3.50	812.5 4	-	-

华泰 证券	20230 33100 01027 3	卓胜 微	2023 年 3 月 31 日	870,8 00.00	7,000. 00	14	3.50	1,150. 73	-	-
华泰 证券	20230 33100 01029 1	温氏 股份	2023 年 3 月 31 日	2,388, 849.0 0	116,7 00.00	28	3.50	6,313. 57	-	-
华泰 证券	20230 40300 00105 3	北京 君正	2023 年 4 月 3 日	110,3 30.00	1,100. 00	14	3.50	145.8 0	-	-
华泰 证券	20230 40700 00715 9	爱尔 眼科	2023 年 4 月 7 日	118,7 16.00	3,900. 00	28	3.50	313.7 6	-	-
华泰 证券	20230 41000 00214 7	华能 水电	2023 年 4 月 10 日	258,0 00.00	37,50 0.00	14	3.20	311.7 2	-	-
华泰 证券	20230 41000 00383 3	紫光 国微	2023 年 4 月 10 日	492,6 60.00	4,200. 00	14	3.20	595.2 3	-	-
华泰 证券	20230 41000 00383 5	世纪 华通	2023 年 4 月 10 日	8,932. 00	1,400. 00	14	3.20	10.79	-	-
华泰 证券	20230 41000 00385 3	中国 船舶	2023 年 4 月 10 日	867,1 53.00	35,70 0.00	7	3.30	540.2 2	-	-
华泰 证券	20230 41100 00149 3	沪硅 产业	2023 年 4 月 11 日	55,12 8.00	2,400. 00	14	3.50	72.85	-	-
华泰 证券	20230 41100 00149 9	东方 证券	2023 年 4 月 11 日	252,7 20.00	21,60 0.00	14	3.20	305.3 4	-	-
华泰 证券	20230 41100 00150 1	用友 网络	2023 年 4 月 11 日	29,64 0.00	1,200. 00	14	3.20	35.81	-	-

华泰 证券	20230 41100 01926 4	贝泰 妮	2023 年 4 月 11 日	356,6 36.00	2,800. 00	14	3.50	471.2 8	-	-
华泰 证券	20230 41100 02396 6	北京 君正	2023 年 4 月 11 日	130,9 44.00	1,200. 00	14	3.50	173.0 4	-	-
华泰 证券	20230 41100 02397 6	锦浪 科技	2023 年 4 月 11 日	528,9 00.00	4,100. 00	14	3.50	698.9 2	-	-
华泰 证券	20230 41100 02431 4	天合 光能	2023 年 4 月 11 日	607,2 00.00	12,00 0.00	14	3.50	802.3 9	-	-
华泰 证券	20230 41200 01357 4	欧普 康视	2023 年 4 月 12 日	329,4 99.00	9,300. 00	14	3.50	435.4 2	-	-
华泰 证券	20230 41200 01357 6	山东 黄金	2023 年 4 月 12 日	96,86 6.00	3,700. 00	14	3.20	117.0 3	-	-
华泰 证券	20230 41200 01357 8	中芯 国际	2023 年 4 月 12 日	112,6 70.00	1,900. 00	14	3.50	148.8 9	-	-
华泰 证券	20230 41300 00310 1	山东 黄金	2023 年 4 月 13 日	121,3 94.00	4,600. 00	28	3.20	293.3 4	-	-
华泰 证券	20230 41400 00202 7	龙佰 集团	2023 年 4 月 14 日	70,66 5.00	3,500. 00	14	3.20	85.38	-	-
华泰 证券	20230 41400 00202 9	深南 电路	2023 年 4 月 14 日	382,5 71.00	4,300. 00	14	3.20	462.2 2	-	-
华泰 证券	20230 41400 00203 9	金域 医学	2023 年 4 月 14 日	399,6 48.00	4,600. 00	14	3.20	482.8 5	-	-

华泰 证券	20230 41400 01162 9	卓胜 微	2023 年 4 月 14 日	923,3 70.00	7,000. 00	14	3.50	1,220. 20	-	-
华泰 证券	20230 41400 01170 5	亿联 网络	2023 年 4 月 14 日	355,1 52.00	5,600. 00	28	3.20	858.1 9	-	-
华泰 证券	20230 41700 01109 0	北京 君正	2023 年 4 月 17 日	112,4 20.00	1,100. 00	17	3.50	180.3 9	-	-
华泰 证券	20230 41700 01265 0	中国 船舶	2023 年 4 月 17 日	885,3 60.00	35,70 0.00	7	3.30	551.5 6	-	-
华泰 证券	20230 41800 00550 7	立讯 精密	2023 年 4 月 18 日	135,8 38.00	4,600. 00	28	3.10	317.9 8	-	-
华泰 证券	20230 41800 00550 9	龙源 电力	2023 年 4 月 18 日	57,44 0.00	3,200. 00	16	3.20	79.31	-	-
华泰 证券	20230 41800 00551 3	广汽 集团	2023 年 4 月 18 日	509,6 80.00	46,00 0.00	28	3.10	1,193. 10	-	-
华泰 证券	20230 41800 00551 5	公牛 集团	2023 年 4 月 18 日	246,8 00.00	1,600. 00	28	3.10	577.7 3	-	-
华泰 证券	20230 41800 00551 7	中芯 国际	2023 年 4 月 18 日	213,1 50.00	3,500. 00	16	3.50	321.9 1	-	-
华泰 证券	20230 41800 00551 9	三峡 能源	2023 年 4 月 18 日	30,02 4.00	5,400. 00	28	3.10	70.28	-	-
华泰 证券	20230 41800 00552 1	韦尔 股份	2023 年 4 月 18 日	1,542, 160.0 0	14,80 0.00	16	3.20	2,129. 41	-	-

华泰 证券	20230 41900 00195 8	药明 康德	2023 年 4 月 19 日	3,404, 544.0 0	42,90 0.00	28	3.10	7,969. 64	-	-
华泰 证券	20230 42000 00177 2	沃森 生物	2023 年 4 月 20 日	186,9 84.00	5,600. 00	28	3.50	494.1 9	-	-
华泰 证券	20230 42000 00177 6	长春 高新	2023 年 4 月 20 日	1,072, 268.0 0	6,700. 00	14	3.20	1,295. 51	-	-
华泰 证券	20230 42000 00178 5	恒力 石化	2023 年 4 月 20 日	491,4 02.00	29,80 0.00	28	3.10	1,150. 32	-	-
华泰 证券	20230 42000 00179 1	春秋 航空	2023 年 4 月 20 日	438,6 90.00	7,000. 00	28	3.10	1,026. 92	-	-
华泰 证券	20230 42000 00179 9	重庆 啤酒	2023 年 4 月 20 日	546,5 50.00	5,000. 00	28	3.10	1,279. 41	-	-
华泰 证券	20230 42100 00280 5	海康 威视	2023 年 4 月 21 日	162,8 52.00	4,100. 00	14	3.20	196.7 6	-	-
华泰 证券	20230 42100 00280 7	海康 威视	2023 年 4 月 21 日	103,2 72.00	2,600. 00	28	3.10	241.7 5	-	-
华泰 证券	20230 42100 00281 9	中芯 国际	2023 年 4 月 21 日	157,0 00.00	2,500. 00	14	3.50	207.4 7	-	-
华泰 证券	20230 42100 00282 8	万泰 生物	2023 年 4 月 21 日	406,2 20.00	3,800. 00	28	3.10	950.9 1	-	-
华泰 证券	20230 42400 00388 5	永兴 材料	2023 年 4 月 24 日	150,6 96.00	2,300. 00	14	3.20	182.0 7	-	-

华泰 证券	20230 42400 00389 1	海康 威视	2023 年 4 月 24 日	467,0 75.00	11,90 0.00	14	3.20	564.3 2	-	-
华泰 证券	20230 42400 00390 1	拓普 集团	2023 年 4 月 24 日	115,5 22.00	2,200. 00	14	3.20	139.5 7	-	-
华泰 证券	20230 42400 00393 2	宝信 软件	2023 年 4 月 24 日	126,9 60.00	2,300. 00	28	3.10	297.2 0	-	-
华泰 证券	20230 42400 00713 9	世纪 华通	2023 年 4 月 24 日	9,296. 00	1,400. 00	14	3.20	11.23	-	-
华泰 证券	20230 42400 00749 5	华能 水电	2023 年 4 月 24 日	257,2 50.00	37,50 0.00	14	3.20	310.8 1	-	-
华泰 证券	20230 42400 01115 3	中国 船舶	2023 年 4 月 24 日	907,8 51.00	35,70 0.00	10	3.30	807.9 6	-	-
华泰 证券	20230 42500 00352 1	邮储 银行	2023 年 4 月 25 日	1,253, 268.0 0	224,6 00.00	28	3.10	2,933. 76	-	-
华泰 证券	20230 42500 00354 6	江西 铜业	2023 年 4 月 25 日	97,82 4.00	4,800. 00	28	3.10	228.9 9	-	-
华泰 证券	20230 42500 05004 7	用友 网络	2023 年 4 月 25 日	26,01 6.00	1,200. 00	14	3.20	31.43	-	-
华泰 证券	20230 42500 05007 7	天合 光能	2023 年 4 月 25 日	544,9 20.00	12,00 0.00	14	3.50	720.0 9	-	-
华泰 证券	20230 42500 05468 1	东方 证券	2023 年 4 月 25 日	230,9 04.00	21,60 0.00	14	3.20	278.9 8	-	-

华泰 证券	20230 42500 05469 9	贝泰 妮	2023 年 4 月 25 日	302,1 48.00	2,800. 00	14	3.50	399.2 8	-	-
华泰 证券	20230 42500 05473 5	锦浪 科技	2023 年 4 月 25 日	456,4 94.00	4,100. 00	14	3.50	603.2 4	-	-
华泰 证券	20230 42500 05479 7	北京 君正	2023 年 4 月 25 日	111,8 76.00	1,200. 00	14	3.50	147.8 4	-	-
华泰 证券	20230 42500 05825 3	沪硅 产业	2023 年 4 月 25 日	54,00 0.00	2,400. 00	14	3.50	71.36	-	-
华泰 证券	20230 42600 00143 7	科大 讯飞	2023 年 4 月 26 日	68,37 6.00	1,200. 00	14	3.20	82.61	-	-
华泰 证券	20230 42600 00143 9	凯莱 英	2023 年 4 月 26 日	482,2 96.00	3,800. 00	14	3.20	582.7 1	-	-
华泰 证券	20230 42600 00144 1	恒瑞 医药	2023 年 4 月 26 日	72,30 0.00	1,500. 00	28	3.10	169.2 5	-	-
华泰 证券	20230 42600 00144 3	江西 铜业	2023 年 4 月 26 日	98,63 7.00	4,900. 00	28	3.10	230.9 0	-	-
华泰 证券	20230 42600 01962 6	欧普 康视	2023 年 4 月 26 日	303,3 66.00	9,300. 00	14	3.50	400.8 9	-	-
华泰 证券	20230 42600 01971 4	山东 黄金	2023 年 4 月 26 日	93,42 5.00	3,700. 00	14	3.20	112.8 8	-	-
华泰 证券	20230 42600 01971 6	中芯 国际	2023 年 4 月 26 日	110,5 04.00	1,900. 00	14	3.50	146.0 3	-	-

华泰 证券	20230 42800 00120 8	陕西 煤业	2023 年 4 月 28 日	29,35 5.00	1,500. 00	14	3.20	35.47	-	-
华泰 证券	20230 42800 00121 2	沪硅 产业	2023 年 4 月 28 日	138,1 56.00	5,800. 00	14	3.50	182.5 7	-	-
华泰 证券	20230 42800 01064 6	金域 医学	2023 年 4 月 28 日	376,2 80.00	4,600. 00	14	3.20	454.6 2	-	-
华泰 证券	20230 42800 01072 4	温氏 股份	2023 年 4 月 28 日	2,308, 326.0 0	116,7 00.00	28	3.50	6,100. 75	-	-
华泰 证券	20230 42800 01079 0	深南 电路	2023 年 4 月 28 日	353,7 18.00	4,300. 00	14	3.20	427.3 6	-	-
华泰 证券	20230 42800 01259 2	卓胜 微	2023 年 4 月 28 日	710,7 10.00	7,000. 00	14	3.50	939.1 8	-	-
华泰 证券	20230 50400 00286 3	泰格 医药	2023 年 5 月 4 日	893,4 00.00	10,00 0.00	28	3.50	2,361. 20	-	-
华泰 证券	20230 50400 00286 5	智飞 生物	2023 年 5 月 4 日	87,32 9.00	1,100. 00	28	3.50	230.8 0	-	-
华泰 证券	20230 50400 00289 9	中芯 国际	2023 年 5 月 4 日	634,6 08.00	10,80 0.00	14	3.50	838.6 1	-	-
华泰 证券	20230 50400 02106 9	中芯 国际	2023 年 5 月 4 日	205,6 60.00	3,500. 00	14	3.50	271.7 7	-	-
华泰 证券	20230 50400 02107 1	韦尔 股份	2023 年 5 月 4 日	1,364, 412.0 0	14,80 0.00	14	3.20	1,648. 48	-	-

华泰 证券	20230 50400 02595 3	长春 高新	2023 年 5 月 4 日	1,113, 339.0 0	6,700. 00	14	3.20	1,345. 13	-	-
华泰 证券	20230 50400 03408 9	龙源 电力	2023 年 5 月 4 日	58,20 8.00	3,200. 00	14	3.20	70.33	-	-
华泰 证券	20230 50400 03526 7	北京 君正	2023 年 5 月 4 日	92,45 5.00	1,100. 00	14	3.50	122.1 8	-	-
华泰 证券	20230 50400 04690 3	中国 船舶	2023 年 5 月 4 日	928,2 00.00	35,70 0.00	7	3.30	578.2 5	-	-
华泰 证券	20230 50500 00316 2	潍柴 动力	2023 年 5 月 5 日	998,4 00.00	78,00 0.00	14	3.20	1,206. 27	-	-
华泰 证券	20230 50500 00318 6	沪硅 产业	2023 年 5 月 5 日	136,8 00.00	6,000. 00	28	3.50	361.5 5	-	-
华泰 证券	20230 50500 00319 0	合盛 硅业	2023 年 5 月 5 日	286,6 80.00	4,000. 00	14	3.20	346.3 7	-	-
华泰 证券	20230 50500 01040 3	海康 威视	2023 年 5 月 5 日	147,8 46.00	4,100. 00	14	3.20	178.6 3	-	-
华泰 证券	20230 50500 01186 7	中芯 国际	2023 年 5 月 5 日	147,0 00.00	2,500. 00	14	3.50	194.2 6	-	-
华泰 证券	20230 50500 01188 7	爱尔 眼科	2023 年 5 月 5 日	112,7 49.00	3,900. 00	28	3.50	297.9 9	-	-
华泰 证券	20230 50800 00179 8	宁波 银行	2023 年 5 月 8 日	31,49 3.00	1,100. 00	14	3.20	38.05	-	-

华泰 证券	20230 50800 00180 5	视源 股份	2023 年 5 月 8 日	78,75 6.00	1,200. 00	14	3.20	95.15	-	-
华泰 证券	20230 50800 00180 7	华峰 化学	2023 年 5 月 8 日	290,6 28.00	41,40 0.00	14	3.20	351.1 4	-	-
华泰 证券	20230 50800 00181 4	圆通 速递	2023 年 5 月 8 日	46,87 2.00	2,800. 00	14	3.20	56.63	-	-
华泰 证券	20230 50800 00182 0	白云 山	2023 年 5 月 8 日	81,83 4.00	2,300. 00	14	3.20	98.87	-	-
华泰 证券	20230 50800 00182 4	用友 网络	2023 年 5 月 8 日	21,30 0.00	1,000. 00	28	3.10	49.86	-	-
华泰 证券	20230 50800 00183 6	航发 动力	2023 年 5 月 8 日	81,89 0.00	1,900. 00	14	3.20	98.94	-	-
华泰 证券	20230 50800 01928 7	永兴 材料	2023 年 5 月 8 日	146,6 25.00	2,300. 00	14	3.20	177.1 5	-	-
华泰 证券	20230 50800 02936 1	世纪 华通	2023 年 5 月 8 日	8,344. 00	1,400. 00	14	3.20	10.08	-	-
华泰 证券	20230 50800 03610 5	华能 水电	2023 年 5 月 8 日	270,3 75.00	37,50 0.00	14	3.20	326.6 7	-	-
华泰 证券	20230 50800 05032 7	海康 威视	2023 年 5 月 8 日	427,4 48.00	11,90 0.00	14	3.20	516.4 4	-	-
华泰 证券	20230 50900 00236 1	中国 银河	2023 年 5 月 9 日	116,0 80.00	8,000. 00	14	3.20	140.2 5	-	-

华泰 证券	20230 50900 00284 3	东方 雨虹	2023 年 5 月 9 日	71,82 5.00	2,500. 00	14	3.20	86.78	-	-
华泰 证券	20230 50900 00284 6	TCL 科技	2023 年 5 月 9 日	44,51 6.00	12,40 0.00	14	3.20	53.78	-	-
华泰 证券	20230 50900 00289 0	民生 银行	2023 年 5 月 9 日	1,290, 000.0 0	300,0 00.00	14	3.20	1,558. 58	-	-
华泰 证券	20230 50900 01584 5	东方 证券	2023 年 5 月 9 日	241,7 04.00	21,60 0.00	14	3.20	292.0 3	-	-
华泰 证券	20230 50900 01757 9	锦浪 科技	2023 年 5 月 9 日	447,3 51.00	4,100. 00	14	3.50	591.1 6	-	-
华泰 证券	20230 50900 01767 7	贝泰 妮	2023 年 5 月 9 日	299,5 72.00	2,800. 00	14	3.50	395.8 7	-	-
华泰 证券	20230 50900 01769 9	沪硅 产业	2023 年 5 月 9 日	54,09 6.00	2,400. 00	14	3.50	71.49	-	-
华泰 证券	20230 51000 00123 3	圆通 速递	2023 年 5 月 10 日	26,43 2.00	1,600. 00	14	3.20	31.94	-	-
华泰 证券	20230 51000 00123 5	中国 银行	2023 年 5 月 10 日	1,897, 693.0 0	440,3 00.00	14	3.20	2,292. 79	-	-
华泰 证券	20230 51000 00123 7	沪硅 产业	2023 年 5 月 10 日	87,48 0.00	4,000. 00	14	3.50	115.6 0	-	-
华泰 证券	20230 51000 00123 9	华鲁 恒升	2023 年 5 月 10 日	197,6 96.00	6,400. 00	14	3.20	238.8 6	-	-

华泰 证券	20230 51000 00948 4	凯莱 英	2023 年 5 月 10 日	482,2 20.00	3,800. 00	14	3.20	582.6 2	-	-
华泰 证券	20230 51100 00203 2	中国 石油	2023 年 5 月 11 日	579,1 17.00	75,90 0.00	14	3.20	699.6 9	-	-
华泰 证券	20230 51100 00203 6	农业 银行	2023 年 5 月 11 日	36,25 9.00	10,10 0.00	14	3.20	43.81	-	-
华泰 证券	20230 51100 00203 8	特变 电工	2023 年 5 月 11 日	229,0 56.00	9,600. 00	14	3.20	276.7 5	-	-
华泰 证券	20230 51100 01520 1	中国 船舶	2023 年 5 月 11 日	946,0 50.00	35,70 0.00	7	3.30	589.3 7	-	-
华泰 证券	20230 51200 00499 0	金城 医学	2023 年 5 月 12 日	347,2 54.00	4,600. 00	14	3.20	419.5 5	-	-
华泰 证券	20230 51200 00915 8	陕西 煤业	2023 年 5 月 12 日	30,21 0.00	1,500. 00	14	3.20	36.50	-	-
华泰 证券	20230 51200 00916 0	沪硅 产业	2023 年 5 月 12 日	116,9 28.00	5,800. 00	14	3.50	154.5 2	-	-
华泰 证券	20230 51500 00223 4	传音 控股	2023 年 5 月 15 日	174,0 00.00	1,500. 00	14	3.50	229.9 4	-	-
华泰 证券	20230 51500 00223 8	中国 石油	2023 年 5 月 15 日	7,470. 00	1,000. 00	14	3.20	9.03	-	-
华泰 证券	20230 51500 00224 2	白云 山	2023 年 5 月 15 日	40,22 4.00	1,200. 00	14	3.20	48.60	-	-

华泰 证券	20230 51600 00149 2	视源 股份	2023 年 5 月 16 日	82,32 9.00	1,300. 00	14	3.20	99.47	-	-
华泰 证券	20230 51700 00284 5	沃森 生物	2023 年 5 月 17 日	106,6 45.00	3,500. 00	14	3.50	140.9 3	-	-
华泰 证券	20230 51700 00289 7	中国 人寿	2023 年 5 月 17 日	1,409, 960.0 0	34,90 0.00	14	3.20	1,703. 51	-	-
华泰 证券	20230 51800 00125 4	福斯 特	2023 年 5 月 18 日	243,6 48.00	5,400. 00	14	3.20	294.3 8	-	-
华泰 证券	20230 51800 00125 6	通威 股份	2023 年 5 月 18 日	95,90 0.00	2,500. 00	14	3.20	115.8 7	-	-
华泰 证券	20230 51800 00125 8	天合 光能	2023 年 5 月 18 日	80,49 5.00	1,700. 00	14	3.50	106.3 7	-	-
华泰 证券	20230 51800 00126 0	三峡 能源	2023 年 5 月 18 日	39,16 8.00	7,200. 00	14	3.20	47.32	-	-
华泰 证券	20230 51800 00179 1	中煤 能源	2023 年 5 月 18 日	206,7 52.00	22,40 0.00	14	3.20	249.8 0	-	-
华泰 证券	20230 51800 00179 7	合盛 硅业	2023 年 5 月 18 日	70,13 0.00	1,000. 00	14	3.20	84.73	-	-
华泰 证券	20230 51800 00180 1	玲珑 轮胎	2023 年 5 月 18 日	242,5 36.00	12,20 0.00	14	3.20	293.0 3	-	-
华泰 证券	20230 51800 00180 5	青岛 啤酒	2023 年 5 月 18 日	207,4 00.00	2,000. 00	14	3.20	250.5 8	-	-

华泰 证券	20230 51800 00947 0	中芯 国际	2023 年 5 月 18 日	595,0 80.00	10,80 0.00	14	3.50	786.3 8	-	-
华泰 证券	20230 51800 01212 8	韦尔 股份	2023 年 5 月 18 日	1,411, 920.0 0	14,80 0.00	14	3.20	1,705. 88	-	-
华泰 证券	20230 51800 02304 8	中国 船舶	2023 年 5 月 18 日	1,069, 215.0 0	35,70 0.00	7	3.30	666.1 0	-	-
华泰 证券	20230 51800 03825 8	龙源 电力	2023 年 5 月 18 日	58,94 4.00	3,200. 00	14	3.20	71.22	-	-
华泰 证券	20230 51800 03985 2	北京 君正	2023 年 5 月 18 日	92,69 7.00	1,100. 00	14	3.50	122.5 0	-	-
华泰 证券	20230 51800 04033 2	长春 高新	2023 年 5 月 18 日	1,147, 241.0 0	6,700. 00	14	3.20	1,386. 09	-	-
华泰 证券	20230 51900 00307 1	海康 威视	2023 年 5 月 19 日	498,6 80.00	14,00 0.00	14	3.20	602.5 0	-	-
华泰 证券	20230 51900 01315 1	海康 威视	2023 年 5 月 19 日	146,0 42.00	4,100. 00	14	3.20	176.4 5	-	-
华泰 证券	20230 51900 01316 1	合盛 硅业	2023 年 5 月 19 日	282,6 00.00	4,000. 00	14	3.20	341.4 4	-	-
华泰 证券	20230 51900 01317 5	潍柴 动力	2023 年 5 月 19 日	942,2 40.00	78,00 0.00	14	3.20	1,138. 41	-	-
华泰 证券	20230 52200 00228 9	特变 电工	2023 年 5 月 22 日	112,3 68.00	4,800. 00	14	3.20	135.7 6	-	-

华泰 证券	20230 52200 00229 7	通威 股份	2023 年 5 月 22 日	985,8 56.00	25,60 0.00	14	3.20	1,191. 11	-	-
华泰 证券	20230 52200 01391 2	华能 水电	2023 年 5 月 22 日	282,7 50.00	37,50 0.00	14	3.20	341.6 2	-	-
华泰 证券	20230 52200 01837 4	白云 山	2023 年 5 月 22 日	78,75 2.00	2,300. 00	14	3.20	95.15	-	-
华泰 证券	20230 52200 01900 2	圆通 速递	2023 年 5 月 22 日	45,83 6.00	2,800. 00	14	3.20	55.38	-	-
华泰 证券	20230 52200 02938 8	航发 动力	2023 年 5 月 22 日	79,42 0.00	1,900. 00	14	3.20	95.96	-	-
华泰 证券	20230 52200 02939 0	永兴 材料	2023 年 5 月 22 日	161,3 22.00	2,300. 00	14	3.20	194.9 1	-	-
华泰 证券	20230 52200 03174 0	世纪 华通	2023 年 5 月 22 日	7,574. 00	1,400. 00	14	3.20	9.15	-	-
华泰 证券	20230 52200 03335 2	海康 威视	2023 年 5 月 22 日	426,9 72.00	11,90 0.00	14	3.20	515.8 7	-	-
华泰 证券	20230 52200 05090 6	宁波 银行	2023 年 5 月 22 日	29,55 7.00	1,100. 00	14	3.20	35.71	-	-
华泰 证券	20230 52200 05802 2	华峰 化学	2023 年 5 月 22 日	289,8 00.00	41,40 0.00	14	3.20	350.1 4	-	-
华泰 证券	20230 52300 00330 4	华利 集团	2023 年 5 月 23 日	74,06 4.00	1,600. 00	14	3.50	97.87	-	-

华泰 证券	20230 52300 01030 2	中国 银河	2023 年 5 月 23 日	93,44 0.00	8,000. 00	14	3.20	112.8 9	-	-
华泰 证券	20230 52300 01903 8	东方 雨虹	2023 年 5 月 23 日	67,02 5.00	2,500. 00	14	3.20	80.98	-	-
华泰 证券	20230 52300 01909 2	贝泰 妮	2023 年 5 月 23 日	293,4 40.00	2,800. 00	14	3.50	387.7 7	-	-
华泰 证券	20230 52300 01914 2	锦浪 科技	2023 年 5 月 23 日	432,6 32.00	4,100. 00	14	3.50	571.7 1	-	-
华泰 证券	20230 52300 02246 0	东方 证券	2023 年 5 月 23 日	216,4 32.00	21,60 0.00	14	3.20	261.4 9	-	-
华泰 证券	20230 52400 00871 4	凯莱 英	2023 年 5 月 24 日	506,3 12.00	3,800. 00	14	3.20	611.7 3	-	-
华泰 证券	20230 52400 01576 2	圆通 速递	2023 年 5 月 24 日	25,85 6.00	1,600. 00	14	3.20	31.24	-	-
华泰 证券	20230 52400 01576 4	中国 银行	2023 年 5 月 24 日	1,712, 767.0 0	440,3 00.00	14	3.20	2,069. 36	-	-
华泰 证券	20230 52400 01576 6	华鲁 恒升	2023 年 5 月 24 日	190,0 80.00	6,400. 00	14	3.20	229.6 5	-	-
华泰 证券	20230 52500 00455 5	工业 富联	2023 年 5 月 25 日	873,6 80.00	53,60 0.00	14	3.20	1,055. 58	-	-
华泰 证券	20230 52500 02362 0	中国 船舶	2023 年 5 月 25 日	1,005, 669.0 0	35,70 0.00	7	3.30	626.5 1	-	-

华泰 证券	20230 60100 02355 0	通威 股份	2023 年 6 月 1 日	84,20 0.00	2,500. 00	14	3.20	101.7 3	-	-
华泰 证券	20230 60100 02386 3	福斯 特	2023 年 6 月 1 日	166,5 36.00	5,400. 00	14	3.20	201.2 1	-	-
华泰 证券	20230 60100 02546 7	三峡 能源	2023 年 6 月 1 日	38,95 2.00	7,200. 00	14	3.20	47.06	-	-
华泰 证券	20230 60100 02613 3	天合 光能	2023 年 6 月 1 日	66,30 0.00	1,700. 00	14	3.50	87.61	-	-
华泰 证券	20230 60100 03070 4	韦尔 股份	2023 年 6 月 1 日	1,472, 600.0 0	14,80 0.00	14	3.20	1,779. 19	-	-
华泰 证券	20230 60500 00222 0	三六 零	2023 年 6 月 5 日	930,0 00.00	60,00 0.00	14	3.20	1,123. 62	-	-
华泰 证券	20230 60500 02297 3	通威 股份	2023 年 6 月 5 日	850,9 44.00	25,60 0.00	14	3.20	1,028. 11	-	-
华泰 证券	20230 60600 00164 0	视源 股份	2023 年 6 月 6 日	463,4 77.00	7,300. 00	14	3.20	559.9 7	-	-
华泰 证券	20230 60800 00155 8	长安 汽车	2023 年 6 月 8 日	1,163, 000.0 0	100,0 00.00	18	3.20	1,806. 60	-	-
华泰 证券	20230 60800 00156 0	中国 卫通	2023 年 6 月 8 日	138,5 60.00	8,000. 00	18	3.20	215.2 4	-	-
华泰 证券	20230 60800 00156 2	中科 曙光	2023 年 6 月 8 日	1,195, 680.0 0	24,00 0.00	18	3.20	1,857. 37	-	-

华泰 证券	20230 60800 01921 5	工业 富联	2023 年 6 月 8 日	956,7 60.00	53,60 0.00	18	3.20	1,486. 23	-	-
华泰 证券	20230 61300 00275 9	爱旭 股份	2023 年 6 月 13 日	679,1 40.00	18,00 0.00	14	3.20	820.5 4	-	-
华泰 证券	20230 61300 00377 7	歌尔 股份	2023 年 6 月 13 日	923,2 92.00	49,80 0.00	14	3.20	1,115. 52	-	-
华泰 证券	20230 61300 00377 9	中油 资本	2023 年 6 月 13 日	390,7 20.00	52,80 0.00	14	3.20	472.0 7	-	-
华泰 证券	20230 61300 00378 1	光大 证券	2023 年 6 月 13 日	656,4 72.00	40,80 0.00	14	3.20	793.1 5	-	-
华泰 证券	20230 61300 00378 7	三六 零	2023 年 6 月 13 日	226,0 86.00	14,70 0.00	14	3.20	273.1 6	-	-
华泰 证券	20230 61300 00379 9	士兰 微	2023 年 6 月 13 日	331,0 20.00	10,80 0.00	14	3.20	399.9 4	-	-
华泰 证券	20230 61400 02986 3	士兰 微	2023 年 6 月 14 日	152,3 00.00	5,000. 00	14	3.00	172.5 1	-	-
华泰 证券	20230 61500 02717 9	韦尔 股份	2023 年 6 月 15 日	1,479, 408.0 0	14,80 0.00	14	3.20	1,787. 42	-	-
华泰 证券	20230 61500 02763 6	福斯 特	2023 年 6 月 15 日	174,6 90.00	5,400. 00	14	3.20	211.0 6	-	-
华泰 证券	20230 61500 02781 5	三峡 能源	2023 年 6 月 15 日	38,08 8.00	7,200. 00	14	3.20	46.02	-	-

华泰 证券	20230 61500 02816 5	通威 股份	2023 年 6 月 15 日	83,45 0.00	2,500. 00	14	3.20	100.8 2	-	-
华泰 证券	20230 61500 02834 1	天合 光能	2023 年 6 月 15 日	71,58 7.00	1,700. 00	14	3.50	94.60	-	-
华泰 证券	20230 61900 00531 9	民生 银行	2023 年 6 月 19 日	1,919, 970.0 0	492,3 00.00	14	2.00	1,139. 14	1,846, 125.0 0	1,173. 32
华泰 证券	20230 61900 01818 5	三六 零	2023 年 6 月 19 日	899,4 00.00	60,00 0.00	14	3.20	853.8 0	752,4 00.00	879.4 1
华泰 证券	20230 61900 02124 6	通威 股份	2023 年 6 月 19 日	880,6 40.00	25,60 0.00	14	3.20	835.9 9	878,3 36.00	861.0 7
华泰 证券	20230 62000 00235 5	大华 股份	2023 年 6 月 20 日	808,1 80.00	34,00 0.00	14	3.00	653.8 7	671,5 00.00	673.4 8
华泰 证券	20230 62000 01813 2	华熙 生物	2023 年 6 月 20 日	338,0 32.00	3,700. 00	14	3.50	319.0 7	329,8 92.00	328.6 4
华泰 证券	20230 62000 03677 6	视源 股份	2023 年 6 月 20 日	528,7 39.00	7,300. 00	14	3.20	456.3 0	487,9 32.00	469.9 9
华泰 证券	20230 62100 00465 5	弘元 绿能	2023 年 6 月 21 日	288,5 20.00	4,000. 00	14	3.20	224.0 9	298,2 00.00	230.8 2
华泰 证券	20230 62100 00592 0	高德 红外	2023 年 6 月 21 日	45,96 0.00	6,000. 00	14	3.20	35.70	46,62 0.00	36.77
华泰 证券	20230 62600 00255 2	中国 银河	2023 年 6 月 26 日	207,1 00.00	19,00 0.00	14	3.20	71.49	220,5 90.00	73.64

华泰 证券	20230 62600 03551 4	长安 汽车	2023 年 6 月 26 日	1,285, 000.0 0	100,0 00.00	14	3.20	443.5 8	1,293, 000.0 0	456.8 9
华泰 证券	20230 62600 03551 5	中国 卫通	2023 年 6 月 26 日	164,0 80.00	8,000. 00	14	3.20	56.64	159,0 40.00	58.34
华泰 证券	20230 62600 03666 5	工业 富联	2023 年 6 月 26 日	1,237, 624.0 0	53,60 0.00	14	3.20	427.2 3	1,350, 720.0 0	440.0 4
华泰 证券	20230 62600 03806 7	中科 曙光	2023 年 6 月 26 日	1,180, 560.0 0	24,00 0.00	14	3.20	407.5 3	1,221, 600.0 0	419.7 5
华泰 证券	20230 62700 00828 9	长安 汽车	2023 年 6 月 27 日	53,76 0.00	4,200. 00	14	3.20	13.92	54,30 6.00	14.34
华泰 证券	20230 62700 01594 7	歌尔 股份	2023 年 6 月 27 日	876,9 78.00	49,80 0.00	14	3.20	227.0 5	883,9 50.00	233.8 6
华泰 证券	20230 62700 01637 8	士兰 微	2023 年 6 月 27 日	324,5 40.00	10,80 0.00	14	3.20	84.02	326,9 16.00	86.54
华泰 证券	20230 62700 01723 1	中油 资本	2023 年 6 月 27 日	383,8 56.00	52,80 0.00	14	3.20	99.38	381,7 44.00	102.3 6
华泰 证券	20230 62700 01766 9	光大 证券	2023 年 6 月 27 日	645,0 48.00	40,80 0.00	14	3.20	167.0 0	648,3 12.00	172.0 1
华泰 证券	20230 62700 01830 4	三六 零	2023 年 6 月 27 日	193,0 11.00	14,70 0.00	14	3.20	49.97	184,3 38.00	51.47
华泰 证券	20230 62700 01997 9	爱旭 股份	2023 年 6 月 27 日	557,1 00.00	18,00 0.00	14	3.20	144.2 3	553,5 00.00	148.5 6

华泰 证券	20230 62800 00469 2	三花 智控	2023 年 6 月 28 日	917,8 40.00	30,80 0.00	14	3.50	173.2 7	932,0 08.00	178.4 7
华泰 证券	20230 62800 00815 4	锦浪 科技	2023 年 6 月 28 日	419,2 66.00	4,100. 00	28	3.50	79.15	426,8 10.00	81.52
华泰 证券	20230 62800 00815 5	视源 股份	2023 年 6 月 28 日	101,0 25.00	1,500. 00	14	3.20	17.44	100,2 60.00	17.96
华泰 证券	20230 62800 00816 6	传音 控股	2023 年 6 月 28 日	378,0 00.00	2,700. 00	14	3.50	71.36	396,9 00.00	73.50
华泰 证券	20230 62800 00817 2	士兰 微	2023 年 6 月 28 日	59,28 0.00	2,000. 00	28	3.10	9.91	60,54 0.00	10.21
华泰 证券	20230 62800 00817 6	晨光 股份	2023 年 6 月 28 日	285,1 38.00	6,300. 00	14	3.20	49.21	281,2 32.00	50.69
华泰 证券	20230 62800 03602 7	士兰 微	2023 年 6 月 28 日	148,2 00.00	5,000. 00	14	3.00	23.98	151,3 50.00	24.70
华泰 证券	20230 62900 00864 4	荣盛 石化	2023 年 6 月 29 日	21,83 1.00	1,900. 00	14	3.20	1.88	22,11 6.00	1.94
华泰 证券	20230 62900 03071 9	天合 光能	2023 年 6 月 29 日	71,45 1.00	1,700. 00	14	3.50	6.74	72,43 7.00	6.95
华泰 证券	20230 62900 03169 6	通威 股份	2023 年 6 月 29 日	85,12 5.00	2,500. 00	14	3.20	7.35	85,77 5.00	7.57
华泰 证券	20230 62900 03191 5	福斯 特	2023 年 6 月 29 日	202,5 00.00	5,400. 00	14	3.20	17.48	200,8 26.00	18.00

华泰 证券	20230 62900 03240 2	三峡 能源	2023 年 6 月 29 日	38,66 4.00	7,200. 00	14	3.20	3.34	38,66 4.00	3.44
华泰 证券	20230 62900 03856 6	韦尔 股份	2023 年 6 月 29 日	1,451, 880.0 0	14,80 0.00	14	3.20	125.3 0	1,450, 992.0 0	129.0 6
华泰 证券	20230 63000 00178 1	澜起 科技	2023 年 6 月 30 日	953,1 72.00	16,60 0.00	14	3.50	-	953,1 72.00	-
华泰 证券	20230 63000 00397 5	福耀 玻璃	2023 年 6 月 30 日	75,28 5.00	2,100. 00	14	3.20	-	75,28 5.00	-

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	合约 编号	证券 名称	成交 时间	交易 金额	交易 数量 (单 位:)	出借 期限 (单 位:)	费率	利息 收入	期末 证券 出借 业务 余额	期末 应收 利息 余额
华泰 证券	20220 10600 00104 9	中芯 国际	2022 年 1 月 6 日	1,478, 400.0 0	28,00 0.00	14	3.50	1,953. 66	-	-
华泰 证券	20220 11000 00128 2	宋城 演艺	2022 年 1 月 10 日	99,52 8.00	6,600. 00	14	3.50	131.5 2	-	-
华泰 证券	20220 11100 00112 0	天合 光能	2022 年 1 月 11 日	577,6 68.00	9,200. 00	14	3.50	763.3 7	-	-
华泰 证券	20220 11100 00112 2	华熙 生物	2022 年 1 月 11 日	295,9 53.00	2,100. 00	14	3.50	391.0 9	-	-
华泰 证券	20220 12500 00921 2	天合 光能	2022 年 1 月 25 日	636,3 64.00	9,200. 00	14	3.50	840.9 3	-	-
华泰	20220	天合	2022	552,2	9,200.	14	3.50	729.8	-	-

证券	20800 01583 4	光能	年 2 月 8 日	76.00	00			1		
华泰 证券	20220 20900 00165 2	金山 办公	2022 年 2 月 9 日	938,4 90.00	4,100. 00	14	3.50	1,240. 18	-	-
华泰 证券	20220 20900 00165 4	迈瑞 医疗	2022 年 2 月 9 日	3,186, 651.0 0	10,10 0.00	14	3.50	4,211. 05	-	-
华泰 证券	20220 22200 01363 5	天合 光能	2022 年 2 月 22 日	583,2 80.00	9,200. 00	14	3.50	770.7 9	-	-
华泰 证券	20220 22300 01349 4	迈瑞 医疗	2022 年 2 月 23 日	3,227, 354.0 0	10,10 0.00	14	3.50	4,264. 84	-	-
华泰 证券	20220 30800 01443 4	天合 光能	2022 年 3 月 8 日	673,3 48.00	9,200. 00	14	3.50	889.8 1	-	-
华泰 证券	20220 32200 01035 9	天合 光能	2022 年 3 月 22 日	607,2 00.00	9,200. 00	15	3.50	859.7 1	-	-
华泰 证券	20220 32800 00053 5	三环 集团	2022 年 3 月 28 日	133,2 45.00	4,700. 00	14	3.50	176.0 8	-	-
华泰 证券	20220 40600 06613 3	天合 光能	2022 年 4 月 6 日	514,3 72.00	9,200. 00	14	3.50	679.7 3	-	-
华泰 证券	20220 41100 00688 7	三环 集团	2022 年 4 月 11 日	124,0 33.00	4,700. 00	14	3.50	163.9 1	-	-
华泰 证券	20220 41500 00097 8	澜起 科技	2022 年 4 月 15 日	430,2 60.00	7,100. 00	14	3.50	568.5 7	-	-
华泰	20220	天合	2022	472,7	9,200.	15	3.50	669.4	-	-

证券	42000 05123 6	光能	年 4 月 20 日	88.00	00			0		
华泰 证券	20220 42700 00100 6	蓝思 科技	2022 年 4 月 27 日	17,10 0.00	1,800. 00	14	3.50	22.60	-	-
华泰 证券	20220 42900 00072 2	华熙 生物	2022 年 4 月 29 日	271,0 00.00	2,000. 00	14	3.50	358.1 2	-	-
华泰 证券	20220 42900 00457 6	澜起 科技	2022 年 4 月 29 日	412,1 55.00	7,100. 00	14	3.50	544.6 5	-	-
华泰 证券	20220 50500 07411 9	天合 光能	2022 年 5 月 5 日	479,1 36.00	9,200. 00	14	3.50	633.1 6	-	-
华泰 证券	20220 51100 01011 4	蓝思 科技	2022 年 5 月 11 日	18,00 0.00	1,800. 00	14	3.50	23.79	-	-
华泰 证券	20220 51300 00518 6	澜起 科技	2022 年 5 月 13 日	463,9 85.00	7,100. 00	14	3.50	613.1 4	-	-
华泰 证券	20220 51700 00037 8	温氏 股份	2022 年 5 月 17 日	44,50 0.00	2,500. 00	14	3.50	58.81	-	-
华泰 证券	20220 51800 00080 0	华熙 生物	2022 年 5 月 18 日	263,7 60.00	2,100. 00	14	3.50	348.5 5	-	-
华泰 证券	20220 51900 04777 5	天合 光能	2022 年 5 月 19 日	584,9 36.00	9,200. 00	14	3.50	772.9 7	-	-
华泰 证券	20220 52000 00052 8	三环 集团	2022 年 5 月 20 日	276,9 20.00	9,200. 00	17	3.50	444.3 6	-	-
华泰	20220	华大	2022	291,5	4,400.	17	3.50	467.8	-	-

证券	52000 00053 2	基因	年 5 月 20 日	88.00	00			9		
华泰 证券	20220 52500 00814 3	蓝思 科技	2022 年 5 月 25 日	17,33 4.00	1,800. 00	14	3.50	22.91	-	-
华泰 证券	20220 53000 00070 7	温氏 股份	2022 年 5 月 30 日	38,85 2.00	2,200. 00	14	3.50	51.34	-	-
华泰 证券	20220 60200 00048 5	卓胜 微	2022 年 6 月 2 日	635,3 28.00	3,200. 00	14	3.50	839.5 7	-	-
华泰 证券	20220 61600 00081 7	亿联 网络	2022 年 6 月 16 日	578,1 16.00	7,700. 00	14	3.50	763.9 6	-	-
华泰 证券	20220 62000 00148 6	健帆 生物	2022 年 6 月 20 日	515,6 18.00	10,30 0.00	14	3.50	486.6 9	524,1 67.00	501.3 0
华泰 证券	20220 62100 00074 4	康泰 生物	2022 年 6 月 21 日	604,9 20.00	14,20 0.00	14	3.50	513.8 9	641,5 56.00	529.3 1
华泰 证券	20220 62400 00162 2	欧普 康视	2022 年 6 月 24 日	85,34 4.00	1,600. 00	14	3.50	48.33	91,50 4.00	49.78
华泰 证券	20220 63000 00152 6	欣旺 达	2022 年 6 月 30 日	372,8 80.00	11,80 0.00	14	3.50	-	372,8 80.00	-
华泰 证券	20220 63000 00152 8	泰格 医药	2022 年 6 月 30 日	297,5 70.00	2,600. 00	14	3.50	-	297,5 70.00	-

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	307,346.00	0.04%	300,000.00	0.03%
南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	688,790,219.00	82.47%	690,226,219.00	79.05%

注：南方沪深 300ETF 联接基金、华泰证券投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国工商银行	4,054,105.27	4,000.99	5,648,059.67	4,824.52

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

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	688472	阿特斯	网下申购	62,602	694,882.20
华泰联合	118031	天 23 转债	配债	2,940	294,000.00
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券	301322	绿通科技	网下申购	2,604	341,410.44
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	2,253	72,749.37
兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	网下申购	137,994	785,185.86

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	688048	长光华芯	网下申购	6,790	548,632.00
华泰联合	110085	通 22 转债	配债	4,880	488,000.00
华泰联合	601108	财通证券	配股	51,210	348,228.00
华泰联合	113055	成银转债	配债	3,360	336,000.00
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	5,687	323,476.56
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	12,070	271,937.10
华泰联合	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64
兴业证券	600030	中信证券	配股	114,179	1,647,602.97

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

于本期末，本基金持有关联方兴业证券、华泰证券、工商银行发行的普通股，成本总额为人民币 26,028,822.04 元，估值总额为人民币 23,742,986.64 元，占本基金基金资产净值的比例为 1.49%(上年度末，本基金持有关联方兴业证券、华泰证券、工商银行发行的普通股，成本总额为人民币 27,618,306.63 元，估值总额为人民币 22,880,305.28 元，占本基金基金资产净值的比例为 1.38%)。

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	4,820	277,921.20	277,921.20	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁定期	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定期	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
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	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月	6 个月	新股锁定期	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-

		26 日								
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	37.88	29.49	2,973	112,617.24	87,673.77	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
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	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
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	1,391	76,505.00	76,505.00	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
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	1,973	72,803.70	72,803.70	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
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	346	52,723.48	47,045.62	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	76.80	107.9 5	364	27,955.20	39,293.80	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
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	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
001287	中电港	2023	6 个月	新股锁	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-

		年 3 月 30 日		定期						
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	135.8 0	120.4 1	240	32,592.00	28,898.40	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	245.5 6	122.1 1	150	36,834.00	18,316.50	-
688507	索辰科技	2023 年 6 月 20 日	1-6 个 月 (含)	锁定期 转增	-	122.1 1	72	-	8,791.92	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股锁 定期	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	131.1 1	53.24	261	34,219.71	13,895.64	-
301322	绿通科技	2023 年 5 月 25 日	1-6 个 月 (含)	锁定期 转增	-	53.24	131	-	6,974.44	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-

301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	125.8 8	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁 定期	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月	6 个月	新股锁 定期	10.36	11.84	802	8,308.72	9,495.68	-

		31 日								
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
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	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023	6 个月	新股锁	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-

		年 3 月 29 日		定期						
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
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	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
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	-

6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位: 股)	期末估值总额
1	300750	宁德时代	2023 年 7 月 14 日	228.79	17,000.00	3,889,430.00
2	002475	立讯精密	2023 年 7 月 13 日	32.45	103,400.00	3,355,330.00
3	000063	中兴通讯	2023 年 7 月 13 日	45.54	65,300.00	2,973,762.00
4	002230	科大讯飞	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7	67.96	41,000.00	2,786,360.00

			月 14 日			
5	601138	工业富联	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 10 日	25.20	83,600.00	2,106,720.00
6	600016	民生银行	2023 年 7 月 3 日	3.75	492,300.00	1,846,125.00
7	688111	金山办公	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 13 日	472.22	3,800.00	1,794,436.00
8	603288	海天味业	2023 年 7 月 10 日	46.85	34,900.00	1,635,065.00
9	600150	中国船舶	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	32.91	46,900.00	1,543,479.00
10	000938	紫光股份	2023 年 7 月 10 日	31.85	47,900.00	1,525,615.00
11	603986	兆易创新	2023 年 7 月 13 日	106.25	13,800.00	1,466,250.00
12	603501	韦尔股份	2023 年 7 月 13 日	98.04	14,800.00	1,450,992.00
13	002459	晶澳科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	41.70	34,500.00	1,438,650.00
14	600570	恒生电子	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 13 日	44.29	31,900.00	1,412,851.00
15	002050	三花智控	2023 年 7 月 12 日 -2023 年 7 月 14 日	30.26	45,200.00	1,367,752.00
16	000625	长安汽车	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 11 日	12.93	104,200.00	1,347,306.00
17	002049	紫光国微	2023 年 7 月 13 日	93.25	14,100.00	1,314,825.00
18	603019	中科曙光	2023 年 7 月 10 日	50.90	24,000.00	1,221,600.00
19	603799	华友钴业	2023 年 7	45.91	26,500.00	1,216,615.00

			月 13 日			0
20	002555	三七互娱	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 28 日	34.88	32,600.00	1,137,088.00
21	601989	中国重工	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	4.82	230,100.00	1,109,082.00
22	000977	浪潮信息	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	48.50	21,600.00	1,047,600.00
23	601328	交通银行	2023 年 7 月 14 日	5.80	180,000.00	1,044,000.00
24	688036	传音控股	2023 年 7 月 12 日 -2023 年 7 月 13 日	147.00	6,700.00	984,900.00
25	600438	通威股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	34.31	28,100.00	964,111.00
26	688008	澜起科技	2023 年 7 月 14 日	57.42	16,600.00	953,172.00
27	002466	天齐锂业	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 28 日	69.91	13,400.00	936,794.00
28	601360	三六零	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 11 日	12.54	74,700.00	936,738.00
29	600941	中国移动	2023 年 7 月 25 日	93.30	10,000.00	933,000.00
30	600584	长电科技	2023 年 7 月 13 日	31.17	29,900.00	931,983.00
31	300760	迈瑞医疗	2023 年 7 月 14 日	299.80	3,000.00	899,400.00
32	600745	闻泰科技	2023 年 7 月 4 日	48.90	18,200.00	889,980.00
33	002241	歌尔股份	2023 年 7 月 11 日	17.75	49,800.00	883,950.00
34	000100	TCL 科技	2023 年 7	3.94	217,700.00	857,738.00

			月 10 日 -2023 年 7 月 13 日			
35	601816	京沪高铁	2023 年 7 月 14 日	5.26	161,000.00	846,860.00
36	001979	招商蛇口	2023 年 7 月 5 日	13.03	64,900.00	845,647.00
37	600426	华鲁恒升	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	30.63	26,800.00	820,884.00
38	300274	阳光电源	2023 年 7 月 14 日	116.63	7,000.00	816,410.00
39	002920	德赛西威	2023 年 7 月 3 日	155.81	5,100.00	794,631.00
40	300033	同花顺	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	175.28	4,500.00	788,760.00
41	600845	宝信软件	2023 年 7 月 28 日	50.81	15,100.00	767,231.00
42	000733	振华科技	2023 年 7 月 10 日	95.85	7,600.00	728,460.00
43	601100	恒立液压	2023 年 7 月 5 日	64.33	11,200.00	720,496.00
44	601111	中国国航	2023 年 7 月 10 日	8.24	86,000.00	708,640.00
45	601689	拓普集团	2023 年 7 月 4 日	80.70	8,700.00	702,090.00
46	000792	盐湖股份	2023 年 7 月 14 日	19.17	36,000.00	690,120.00
47	002236	大华股份	2023 年 7 月 4 日	19.75	34,000.00	671,500.00
48	601669	中国电建	2023 年 7 月 25 日	5.74	115,000.00	660,100.00
49	688981	中芯国际	2023 年 7 月 14 日	50.52	13,000.00	656,760.00
50	601788	光大证券	2023 年 7 月 11 日	15.89	40,800.00	648,312.00
51	600115	中国东航	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	4.76	135,000.00	642,600.00
52	002371	北方华创	2023 年 7	317.65	2,000.00	635,300.00

			月 25 日			
53	600346	恒力石化	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	14.33	43,500.00	623,355.00
54	002841	视源股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 12 日	66.84	8,800.00	588,192.00
55	601012	隆基绿能	2023 年 7 月 5 日	28.67	20,500.00	587,735.00
56	601728	中国电信	2023 年 7 月 14 日	5.63	102,000.00	574,260.00
57	600188	兖矿能源	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 14 日	29.92	19,000.00	568,480.00
58	002812	恩捷股份	2023 年 7 月 4 日	96.35	5,900.00	568,465.00
59	300661	圣邦股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	82.13	6,800.00	558,484.00
60	600732	爱旭股份	2023 年 7 月 11 日	30.75	18,000.00	553,500.00
61	600460	士兰微	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 26 日	30.27	17,800.00	538,806.00
62	605117	德业股份	2023 年 7 月 4 日	149.55	3,600.00	538,380.00
63	300413	芒果超媒	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	34.21	15,700.00	537,097.00
64	002648	卫星化学	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 14 日	14.96	35,300.00	528,088.00
65	601857	中国石油	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 12 日	7.47	63,500.00	474,345.00
66	600132	重庆啤酒	2023 年 7	92.16	5,000.00	460,800.00

			月 13 日			
67	300763	锦浪科技	2023 年 7 月 26 日	104.10	4,100.00	426,810.00
68	000723	美锦能源	2023 年 7 月 13 日	7.54	54,600.00	411,684.00
69	600999	招商证券	2023 年 7 月 4 日	13.57	29,300.00	397,601.00
70	601901	方正证券	2023 年 7 月 4 日	6.54	60,100.00	393,054.00
71	000617	中油资本	2023 年 7 月 11 日	7.23	52,800.00	381,744.00
72	601998	中信银行	2023 年 7 月 13 日	5.98	63,600.00	380,328.00
73	600803	新奥股份	2023 年 7 月 11 日	18.98	19,000.00	360,620.00
74	600674	川投能源	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 11 日	15.05	23,900.00	359,695.00
75	603486	科沃斯	2023 年 7 月 10 日	77.77	4,600.00	357,742.00
76	000876	新希望	2023 年 7 月 3 日	11.68	30,000.00	350,400.00
77	603899	晨光股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 12 日	44.64	7,700.00	343,728.00
78	688363	华熙生物	2023 年 7 月 4 日	89.16	3,700.00	329,892.00
79	601881	中国银河	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	11.61	27,000.00	313,470.00
80	300999	金龙鱼	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	39.99	7,700.00	307,923.00
81	603185	弘元绿能	2023 年 7 月 5 日	74.55	4,000.00	298,200.00
82	601216	君正集团	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	4.10	70,800.00	290,280.00
83	601006	大秦铁路	2023 年 7	7.43	39,000.00	289,770.00

			月 14 日			
84	600547	山东黄金	2023 年 7 月 14 日	23.48	12,000.00	281,760.00
85	600383	金地集团	2023 年 7 月 13 日	7.21	38,400.00	276,864.00
86	002601	龙佰集团	2023 年 7 月 4 日	16.50	16,500.00	272,250.00
87	603659	璞泰来	2023 年 7 月 14 日	38.22	7,000.00	267,540.00
88	603392	万泰生物	2023 年 7 月 13 日	66.77	4,000.00	267,080.00
89	603260	合盛硅业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	70.02	3,600.00	252,072.00
90	002120	韵达股份	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 14 日	9.56	24,200.00	231,352.00
91	601238	广汽集团	2023 年 7 月 13 日	10.42	22,200.00	231,324.00
92	603195	公牛集团	2023 年 7 月 10 日	96.06	2,400.00	230,544.00
93	601872	招商轮船	2023 年 7 月 14 日	5.79	39,000.00	225,810.00
94	600905	三峡能源	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 13 日	5.37	40,700.00	218,559.00
95	603369	今世缘	2023 年 7 月 14 日	52.80	4,000.00	211,200.00
96	002493	荣盛石化	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	11.64	18,000.00	209,520.00
97	603806	福斯特	2023 年 7 月 13 日	37.19	5,400.00	200,826.00
98	300496	中科创达	2023 年 7 月 14 日	96.35	2,000.00	192,700.00
99	688065	凯赛生物	2023 年 7 月 12 日 -2023 年 7 月 14 日	62.26	3,000.00	186,780.00
100	600048	保利发展	2023 年 7	13.03	14,200.00	185,026.00

			月 12 日			
101	300759	康龙化成	2023 年 7 月 13 日	38.28	4,600.00	176,088.00
102	601615	明阳智能	2023 年 7 月 14 日	16.88	10,000.00	168,800.00
103	601698	中国卫通	2023 年 7 月 10 日	19.88	8,000.00	159,040.00
104	601236	红塔证券	2023 年 7 月 4 日	7.45	19,700.00	146,765.00
105	600183	生益科技	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	14.20	10,100.00	143,420.00
106	601995	中金公司	2023 年 7 月 10 日	35.52	4,000.00	142,080.00
107	300979	华利集团	2023 年 7 月 12 日	48.74	2,900.00	141,346.00
108	000983	山西焦煤	2023 年 7 月 14 日	9.10	15,000.00	136,500.00
109	000768	中航西飞	2023 年 7 月 3 日	26.75	4,700.00	125,725.00
110	601799	星宇股份	2023 年 7 月 14 日	123.60	1,000.00	123,600.00
111	002821	凯莱英	2023 年 7 月 4 日	117.86	1,000.00	117,860.00
112	000877	天山股份	2023 年 7 月 14 日	8.14	14,300.00	116,402.00
113	300454	深信服	2023 年 7 月 12 日	113.25	1,000.00	113,250.00
114	600763	通策医疗	2023 年 7 月 11 日	96.86	1,100.00	106,546.00
115	601838	成都银行	2023 年 7 月 12 日	12.21	8,000.00	97,680.00
116	002460	赣锋锂业	2023 年 7 月 13 日	60.96	1,600.00	97,536.00
117	002064	华峰化学	2023 年 7 月 14 日	6.86	13,000.00	89,180.00
118	300957	贝泰妮	2023 年 7 月 14 日	88.88	1,000.00	88,880.00
119	002027	分众传媒	2023 年 7 月 5 日	6.81	13,000.00	88,530.00
120	600660	福耀玻璃	2023 年 7 月 14 日	35.85	2,100.00	75,285.00
121	688599	天合光能	2023 年 7	42.61	1,700.00	72,437.00

			月 13 日			
122	300059	东方财富	2023 年 7 月 4 日	14.20	4,500.00	63,900.00
123	002756	永兴材料	2023 年 7 月 3 日	62.61	1,000.00	62,610.00
124	001289	龙源电力	2023 年 7 月 4 日	22.50	2,600.00	58,500.00
125	002414	高德红外	2023 年 7 月 5 日	7.77	6,000.00	46,620.00
126	000776	广发证券	2023 年 7 月 11 日	14.71	3,000.00	44,130.00
127	601186	中国铁建	2023 年 7 月 14 日	9.85	2,300.00	22,655.00
128	600061	国投资本	2023 年 7 月 5 日	7.12	2,600.00	18,512.00
129	003816	中国广核	2023 年 7 月 5 日	3.11	2,800.00	8,708.00
130	600219	南山铝业	2023 年 7 月 12 日	3.02	2,700.00	8,154.00
131	601668	中国建筑	2023 年 7 月 11 日	5.74	1,100.00	6,314.00
合计	-	-	-	-	4,241,500.00	83,848,688.00

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽

核部和风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估,督察长负责组织指导监察稽核工作。

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

6.4.9.2 信用风险

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

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

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时,由于部分成份股流动性差,导致本基金难以及时完成组合调整,或承受较大市场冲击成本,从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的投资股指期货,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。

本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，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%。

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。

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	4,054,105.27	-	-	-	4,054,105.27
结算备付金	876,744.57	-	-	-	876,744.57
存出保证金	45,082.21	-	-	275,788.80	320,871.01
交易性金融 资产	-	-	-	1,592,217.65 5.31	1,592,217.65 5.31
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	-	-	-	323,279.20	323,279.20
应收股利	-	-	-	154,023.80	154,023.80
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	24,560.42	24,560.42
资产总计	4,975,932.05	-	-	1,592,995.30 7.53	1,597,971.23 9.58
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融 负债	-	-	-	-	-
衍生金融负 债	-	-	-	-	-
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	654,491.44	654,491.44
应付托管费	-	-	-	130,898.30	130,898.30
应付销售服 务费	-	-	-	-	-
应付投资顾	-	-	-	-	-

问费					
应交税费	-	-	-	3,823.07	3,823.07
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税 负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	989,938.28	989,938.28
负债总计	-	-	-	1,779,151.09	1,779,151.09
利率敏感度 缺口	4,975,932.05	-	-	1,591,216.15 6.44	1,596,192.08 8.49
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	2,968,593.12	-	-	-	2,968,593.12
结算备付金	316,306.43	-	-	-	316,306.43
存出保证金	51,408.32	-	-	279,792.00	331,200.32
交易性金融 资产	-	-	-	1,658,851.96 3.66	1,658,851.96 3.66
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	-	-	-	207,885.43	207,885.43
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	37,420.76	37,420.76
资产总计	3,336,307.87	-	-	1,659,377.06 1.85	1,662,713.36 9.72
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融 负债	-	-	-	-	-
衍生金融负 债	-	-	-	-	-
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-

应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	707,106.21	707,106.21
应付托管费	-	-	-	141,421.23	141,421.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2,791.16	2,791.16
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,328,450.07	1,328,450.07
负债总计	-	-	-	2,179,768.67	2,179,768.67
利率敏感度缺口	3,336,307.87	-	-	1,657,197.29 3.18	1,660,533.60 1.05

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法，跟踪沪深 300 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，沪深 300 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货

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	1,592,217,655.31	99.75	1,658,851,963.66	99.90
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	1,592,217,655.31	99.75	1,658,851,963.66	99.90

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%	79,339,134.27	82,719,168.16
	2.组合自身基准下降 5%	-79,339,134.27	-82,719,168.16

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	1,590,185,910.00
第二层次	610,383.14
第三层次	1,421,362.17
合计	1,592,217,655.31

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。

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	1,592,217,655.31	99.64
	其中：股票	1,592,217,655.31	99.64
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	4,930,849.84	0.31
8	其他资产	822,734.43	0.05
9	合计	1,597,971,239.58	100.00

注: 1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值, 而下表中的合计项中不含可退替代款估值增值;

2、通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 83,848,688.00 元, 占基金资产净值的比例为 5.25%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	17,798,769.05	1.12
B	采矿业	61,964,713.74	3.88
C	制造业	898,595,891.90	56.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,445,167.43	2.97
E	建筑业	37,715,566.83	2.36
F	批发和零售业	5,297,978.41	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	49,556,240.52	3.10
H	住宿和餐饮业	1,630,090.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	78,988,724.65	4.95
J	金融业	325,701,918.41	20.40
K	房地产业	23,833,145.38	1.49
L	租赁和商务服务业	14,874,242.08	0.93
M	科学研究和技术服务业	15,516,806.91	0.97
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	9,111,287.85	0.57
R	文化、体育和娱乐业	2,155,366.84	0.14
S	综合	-	-
	合计	1,590,185,910.00	99.62

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	----------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,771,073.10	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	8,140.64	0.00
F	批发和零售业	69,029.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	102,137.56	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,031,745.31	0.13

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	52,847	89,364,277.00	5.60
2	300750	宁德时代	221,960	50,782,228.40	3.18
3	601318	中国平安	911,652	42,300,652.80	2.65
4	600036	招商银行	1,041,642	34,124,191.92	2.14
5	000858	五粮液	163,278	26,707,382.46	1.67
6	000333	美的集团	413,624	24,370,726.08	1.53
7	002594	比亚迪	76,311	19,708,841.97	1.23
8	601166	兴业银行	1,223,785	19,152,235.25	1.20
9	600900	长江电力	823,603	18,168,682.18	1.14
10	600276	恒瑞医药	375,792	18,000,436.80	1.13
11	600030	中信证券	821,409	16,247,470.02	1.02

12	601899	紫金矿业	1,386,187	15,760,946.19	0.99
13	600887	伊利股份	535,736	15,172,043.52	0.95
14	300059	东方财富	1,067,522	15,158,812.40	0.95
15	601012	隆基绿能	510,383	14,632,680.61	0.92
16	601398	工商银行	2,949,600	14,217,072.00	0.89
17	600309	万华化学	158,493	13,922,025.12	0.87
18	000651	格力电器	379,164	13,843,277.64	0.87
19	002475	立讯精密	420,160	13,634,192.00	0.85
20	601328	交通银行	2,312,234	13,410,957.20	0.84
21	002415	海康威视	394,059	13,047,293.49	0.82
22	000568	泸州老窖	61,934	12,979,508.38	0.81
23	000725	京东方 A	3,155,282	12,905,103.38	0.81
24	300760	迈瑞医疗	40,800	12,231,840.00	0.77
25	000063	中兴通讯	268,275	12,217,243.50	0.77
26	601816	京沪高铁	2,066,300	10,868,738.00	0.68
27	603259	药明康德	172,661	10,758,506.91	0.67
28	002230	科大讯飞	155,857	10,592,041.72	0.66
29	300274	阳光电源	87,500	10,205,125.00	0.64
30	600028	中国石化	1,600,857	10,181,450.52	0.64
31	601668	中国建筑	1,764,462	10,128,011.88	0.63
32	300124	汇川技术	156,814	10,069,026.94	0.63
33	002714	牧原股份	230,187	9,702,382.05	0.61
34	601288	农业银行	2,686,574	9,483,606.22	0.59
35	002352	顺丰控股	206,000	9,288,540.00	0.58
36	000001	平安银行	816,511	9,169,418.53	0.57
37	601888	中国中免	82,156	9,080,702.68	0.57
38	002129	TCL 中环	271,950	9,028,740.00	0.57
39	000792	盐湖股份	457,200	8,764,524.00	0.55
40	601088	中国神华	277,530	8,534,047.50	0.53
41	002142	宁波银行	333,405	8,435,146.50	0.53
42	601138	工业富联	334,300	8,424,360.00	0.53
43	688981	中芯国际	164,731	8,322,210.12	0.52
44	600031	三一重工	499,931	8,313,852.53	0.52
45	300498	温氏股份	441,220	8,096,387.00	0.51
46	000002	万科 A	572,813	8,030,838.26	0.50
47	600048	保利发展	604,409	7,875,449.27	0.49
48	600016	民生银行	2,089,024	7,833,840.00	0.49
49	600406	国电南瑞	338,000	7,807,800.00	0.49
50	600438	通威股份	227,300	7,798,663.00	0.49
51	600050	中国联通	1,605,889	7,708,267.20	0.48
52	600809	山西汾酒	41,080	7,602,675.60	0.48
53	600837	海通证券	812,500	7,491,250.00	0.47
54	601601	中国太保	288,064	7,483,902.72	0.47

55	600690	海尔智家	318,506	7,478,520.88	0.47
56	601728	中国电信	1,306,600	7,356,158.00	0.46
57	600919	江苏银行	994,320	7,308,252.00	0.46
58	600089	特变电工	327,227	7,293,889.83	0.46
59	688111	金山办公	15,438	7,290,132.36	0.46
60	300015	爱尔眼科	392,487	7,280,633.85	0.46
61	600436	片仔癀	25,400	7,273,544.00	0.46
62	600000	浦发银行	988,019	7,153,257.56	0.45
63	601857	中国石油	953,843	7,125,207.21	0.45
64	600941	中国移动	76,000	7,090,800.00	0.44
65	002371	北方华创	22,264	7,072,159.60	0.44
66	601988	中国银行	1,773,755	6,935,382.05	0.43
67	603501	韦尔股份	69,790	6,842,211.60	0.43
68	002304	洋河股份	50,773	6,669,033.55	0.42
69	601766	中国中车	1,023,668	6,653,842.00	0.42
70	603288	海天味业	140,360	6,575,866.00	0.41
71	601390	中国中铁	864,492	6,552,849.36	0.41
72	600905	三峡能源	1,204,400	6,467,628.00	0.41
73	300014	亿纬锂能	103,300	6,249,650.00	0.39
74	600150	中国船舶	188,200	6,193,662.00	0.39
75	000938	紫光股份	192,567	6,133,258.95	0.38
76	002466	天齐锂业	87,000	6,082,170.00	0.38
77	601688	华泰证券	433,400	5,967,918.00	0.37
78	603986	兆易创新	56,108	5,961,475.00	0.37
79	601225	陕西煤业	326,310	5,935,578.90	0.37
80	002027	分众传媒	850,740	5,793,539.40	0.36
81	002459	晶澳科技	138,820	5,788,794.00	0.36
82	002460	赣锋锂业	94,940	5,787,542.40	0.36
83	601169	北京银行	1,245,549	5,766,891.87	0.36
84	688012	中微公司	36,388	5,692,902.60	0.36
85	000338	潍柴动力	456,660	5,689,983.60	0.36
86	600570	恒生电子	127,960	5,667,348.40	0.36
87	601985	中国核电	794,000	5,597,700.00	0.35
88	600104	上汽集团	393,241	5,572,224.97	0.35
89	002050	三花智控	181,311	5,486,470.86	0.34
90	000625	长安汽车	418,107	5,406,123.51	0.34
91	002049	紫光国微	57,208	5,334,646.00	0.33
92	601211	国泰君安	379,300	5,306,407.00	0.33
93	600111	北方稀土	212,994	5,107,596.12	0.32
94	601919	中远海控	536,120	5,039,528.00	0.32
95	603019	中科曙光	98,556	5,016,500.40	0.31
96	000100	TCL 科技	1,264,329	4,981,456.26	0.31
97	603799	华友钴业	107,716	4,945,241.56	0.31

98	601628	中国人寿	140,153	4,899,748.88	0.31
99	002179	中航光电	107,027	4,853,674.45	0.30
100	600660	福耀玻璃	134,869	4,835,053.65	0.30
101	601229	上海银行	836,914	4,812,255.50	0.30
102	601818	光大银行	1,562,185	4,795,907.95	0.30
103	600585	海螺水泥	201,953	4,794,364.22	0.30
104	002812	恩捷股份	49,400	4,759,690.00	0.30
105	600009	上海机场	104,740	4,757,290.80	0.30
106	600893	航发动力	112,141	4,739,078.66	0.30
107	601989	中国重工	959,435	4,624,476.70	0.29
108	002271	东方雨虹	169,600	4,623,296.00	0.29
109	601658	邮储银行	934,400	4,569,216.00	0.29
110	002555	三七互娱	130,700	4,558,816.00	0.29
111	300122	智飞生物	100,942	4,461,636.40	0.28
112	600958	东方证券	439,988	4,267,883.60	0.27
113	600999	招商证券	312,272	4,237,531.04	0.27
114	600019	宝钢股份	749,385	4,211,543.70	0.26
115	000977	浪潮信息	86,736	4,206,696.00	0.26
116	600760	中航沈飞	92,777	4,174,965.00	0.26
117	300896	爱美客	9,100	4,049,045.00	0.25
118	002709	天赐材料	97,200	4,003,668.00	0.25
119	688036	传音控股	27,082	3,981,054.00	0.25
120	300316	晶盛机电	55,100	3,906,590.00	0.24
121	688599	天合光能	91,453	3,896,812.33	0.24
122	688008	澜起科技	66,904	3,841,627.68	0.24
123	600426	华鲁恒升	125,100	3,831,813.00	0.24
124	601186	中国铁建	387,203	3,813,949.55	0.24
125	601360	三六零	300,700	3,770,778.00	0.24
126	600584	长电科技	119,790	3,733,854.30	0.23
127	601006	大秦铁路	500,406	3,718,016.58	0.23
128	000661	长春高新	27,230	3,711,449.00	0.23
129	601600	中国铝业	667,398	3,664,015.02	0.23
130	000776	广发证券	249,069	3,663,804.99	0.23
131	002920	德赛西威	23,400	3,645,954.00	0.23
132	002410	广联达	112,080	3,641,479.20	0.23
133	600745	闻泰科技	73,200	3,579,480.00	0.22
134	300142	沃森生物	135,236	3,576,992.20	0.22
135	002241	歌尔股份	201,464	3,575,986.00	0.22
136	600547	山东黄金	152,124	3,571,871.52	0.22
137	601377	兴业证券	581,372	3,557,996.64	0.22
138	600588	用友网络	173,321	3,553,080.50	0.22
139	601939	建设银行	565,124	3,537,676.24	0.22
140	000166	申万宏源	758,591	3,504,690.42	0.22

141	601009	南京银行	435,261	3,482,088.00	0.22
142	600011	华能国际	370,200	3,428,052.00	0.21
143	600010	包钢股份	1,910,586	3,419,948.94	0.21
144	001979	招商蛇口	260,484	3,394,106.52	0.21
145	000596	古井贡酒	13,700	3,389,106.00	0.21
146	300450	先导智能	92,300	3,338,491.00	0.21
147	601669	中国电建	579,842	3,328,293.08	0.21
148	600085	同仁堂	57,688	3,320,521.28	0.21
149	300408	三环集团	112,900	3,313,615.00	0.21
150	600196	复星医药	107,080	3,308,772.00	0.21
151	002311	海大集团	69,900	3,274,116.00	0.21
152	601800	中国交建	299,087	3,263,039.17	0.20
153	603659	璞泰来	84,890	3,244,495.80	0.20
154	000963	华东医药	73,793	3,200,402.41	0.20
155	600886	国投电力	250,939	3,174,378.35	0.20
156	000538	云南白药	60,484	3,174,200.32	0.20
157	300033	同花顺	18,100	3,172,568.00	0.20
158	603993	洛阳钼业	594,630	3,169,377.90	0.20
159	000768	中航西飞	117,089	3,132,130.75	0.20
160	600600	青岛啤酒	29,837	3,092,008.31	0.19
161	600845	宝信软件	60,557	3,076,901.17	0.19
162	300782	卓胜微	31,420	3,036,114.60	0.19
163	601689	拓普集团	37,100	2,993,970.00	0.19
164	002252	上海莱士	397,080	2,982,070.80	0.19
165	002493	荣盛石化	255,600	2,975,184.00	0.19
166	000733	振华科技	30,700	2,942,595.00	0.18
167	600926	杭州银行	249,500	2,931,625.00	0.18
168	601100	恒立液压	45,172	2,905,914.76	0.18
169	600015	华夏银行	535,723	2,898,261.43	0.18
170	600795	国电电力	750,530	2,874,529.90	0.18
171	600176	中国巨石	202,111	2,861,891.76	0.18
172	002180	纳思达	83,400	2,856,450.00	0.18
173	300347	泰格医药	44,100	2,846,214.00	0.18
174	600732	爱旭股份	92,280	2,837,610.00	0.18
175	600674	川投能源	187,700	2,824,885.00	0.18
176	000157	中联重科	418,043	2,821,790.25	0.18
177	603369	今世缘	52,800	2,787,840.00	0.17
178	002236	大华股份	139,963	2,764,269.25	0.17
179	600115	中国东航	576,114	2,742,302.64	0.17
180	600029	南方航空	453,700	2,735,811.00	0.17
181	000425	徐工机械	397,785	2,693,004.45	0.17
182	601066	中信建投	109,300	2,645,060.00	0.17
183	000301	东方盛虹	222,500	2,629,950.00	0.16

184	601995	中金公司	73,800	2,621,376.00	0.16
185	601633	长城汽车	103,905	2,615,288.85	0.16
186	601788	光大证券	164,400	2,612,316.00	0.16
187	300496	中科创达	26,900	2,591,815.00	0.16
188	601336	新华保险	70,235	2,582,540.95	0.16
189	601117	中国化学	308,500	2,554,380.00	0.16
190	601868	中国能建	1,091,600	2,554,344.00	0.16
191	600346	恒力石化	177,760	2,547,300.80	0.16
192	601877	正泰电器	90,500	2,502,325.00	0.16
193	002074	国轩高科	89,800	2,480,276.00	0.16
194	002202	金风科技	232,406	2,468,151.72	0.15
195	600741	华域汽车	132,704	2,449,715.84	0.15
196	601111	中国国航	293,831	2,421,167.44	0.15
197	688126	沪硅产业	115,019	2,403,897.10	0.15
198	002001	新和成	156,042	2,403,046.80	0.15
199	601618	中国中冶	600,967	2,385,838.99	0.15
200	300454	深信服	21,000	2,378,250.00	0.15
201	002821	凯莱英	20,140	2,373,700.40	0.15
202	002841	视源股份	35,440	2,368,809.60	0.15
203	688223	晶科能源	168,311	2,366,452.66	0.15
204	600989	宝丰能源	185,100	2,334,111.00	0.15
205	603806	福斯特	62,732	2,333,003.08	0.15
206	688396	华润微	44,356	2,324,697.96	0.15
207	600188	兖矿能源	77,300	2,312,816.00	0.14
208	601838	成都银行	188,600	2,302,806.00	0.14
209	601901	方正证券	346,341	2,265,070.14	0.14
210	300661	圣邦股份	27,565	2,263,913.45	0.14
211	601615	明阳智能	133,800	2,258,544.00	0.14
212	000876	新希望	190,998	2,230,856.64	0.14
213	688303	大全能源	54,023	2,185,230.35	0.14
214	600460	士兰微	71,500	2,164,305.00	0.14
215	605117	德业股份	14,440	2,159,502.00	0.14
216	600039	四川路桥	220,080	2,158,984.80	0.14
217	300413	芒果超媒	63,004	2,155,366.84	0.14
218	000895	双汇发展	87,495	2,142,752.55	0.13
219	603392	万泰生物	32,037	2,139,110.49	0.13
220	002648	卫星化学	141,720	2,120,131.20	0.13
221	002736	国信证券	242,701	2,118,779.73	0.13
222	600233	圆通速递	144,800	2,108,288.00	0.13
223	601607	上海医药	93,600	2,097,576.00	0.13
224	000786	北新建材	85,300	2,090,703.00	0.13
225	603260	合盛硅业	29,800	2,086,596.00	0.13
226	300769	德方纳米	18,780	2,070,119.40	0.13

227	002007	华兰生物	92,155	2,065,193.55	0.13
228	003816	中国广核	662,100	2,059,131.00	0.13
229	300207	欣旺达	125,400	2,046,528.00	0.13
230	300999	金龙鱼	50,200	2,007,498.00	0.13
231	002601	龙佰集团	120,600	1,989,900.00	0.12
232	300751	迈为股份	11,680	1,978,358.40	0.12
233	300433	蓝思科技	167,397	1,968,588.72	0.12
234	601238	广汽集团	186,500	1,943,330.00	0.12
235	600383	金地集团	265,953	1,917,521.13	0.12
236	300759	康龙化成	49,950	1,912,086.00	0.12
237	601021	春秋航空	32,900	1,890,763.00	0.12
238	600332	白云山	59,179	1,886,626.52	0.12
239	600132	重庆啤酒	20,400	1,880,064.00	0.12
240	600763	通策医疗	18,900	1,830,654.00	0.11
241	300223	北京君正	20,300	1,792,693.00	0.11
242	600219	南山铝业	591,200	1,785,424.00	0.11
243	600875	东方电气	93,500	1,743,775.00	0.11
244	000983	山西焦煤	191,100	1,739,010.00	0.11
245	300763	锦浪科技	16,700	1,738,470.00	0.11
246	002756	永兴材料	27,220	1,704,244.20	0.11
247	600362	江西铜业	87,295	1,656,859.10	0.10
248	601865	福莱特	42,800	1,648,228.00	0.10
249	000723	美锦能源	218,500	1,647,490.00	0.10
250	601699	潞安环能	100,700	1,643,424.00	0.10
251	600754	锦江酒店	38,500	1,630,090.00	0.10
252	600918	中泰证券	234,600	1,621,086.00	0.10
253	601878	浙商证券	163,200	1,612,416.00	0.10
254	601872	招商轮船	273,500	1,583,565.00	0.10
255	601319	中国人保	268,900	1,570,376.00	0.10
256	603290	斯达半导	7,200	1,549,440.00	0.10
257	601998	中信银行	257,932	1,542,433.36	0.10
258	600061	国投资本	216,300	1,540,056.00	0.10
259	000617	中油资本	212,800	1,538,544.00	0.10
260	000069	华侨城 A	345,143	1,518,629.20	0.10
261	603486	科沃斯	19,300	1,500,961.00	0.09
262	000408	藏格矿业	66,500	1,500,905.00	0.09
263	300628	亿联网络	42,500	1,490,475.00	0.09
264	600803	新奥股份	78,200	1,484,236.00	0.09
265	601799	星宇股份	12,000	1,483,200.00	0.09
266	603833	欧派家居	15,344	1,469,955.20	0.09
267	688363	华熙生物	16,226	1,446,710.16	0.09
268	600884	杉杉股份	95,300	1,442,842.00	0.09
269	688005	容百科技	26,636	1,438,876.72	0.09

270	300601	康泰生物	56,380	1,431,488.20	0.09
271	002938	鹏鼎控股	58,600	1,423,394.00	0.09
272	600183	生益科技	98,500	1,398,700.00	0.09
273	603899	晨光股份	31,200	1,392,768.00	0.09
274	300919	中伟股份	22,600	1,361,650.00	0.09
275	000708	中信特钢	84,900	1,344,816.00	0.08
276	601898	中煤能源	154,000	1,299,760.00	0.08
277	002916	深南电路	17,240	1,299,378.80	0.08
278	603185	弘元绿能	17,300	1,289,715.00	0.08
279	601881	中国银河	108,500	1,259,685.00	0.08
280	600018	上港集团	235,182	1,234,705.50	0.08
281	688561	奇安信	23,110	1,197,329.10	0.08
282	000877	天山股份	145,800	1,186,812.00	0.07
283	002120	韵达股份	122,126	1,167,524.56	0.07
284	601216	君正集团	283,996	1,164,383.60	0.07
285	002064	华峰化学	167,100	1,146,306.00	0.07
286	002414	高德红外	143,745	1,116,898.65	0.07
287	601155	新城控股	76,100	1,096,601.00	0.07
288	600025	华能水电	151,500	1,080,195.00	0.07
289	600606	绿地控股	354,864	975,876.00	0.06
290	300957	贝泰妮	10,700	951,016.00	0.06
291	603195	公牛集团	9,716	933,318.96	0.06
292	688187	时代电气	21,990	920,501.40	0.06
293	688065	凯赛生物	14,627	910,677.02	0.06
294	601698	中国卫通	35,600	707,728.00	0.04
295	601808	中海油服	49,800	691,224.00	0.04
296	000800	一汽解放	78,300	655,371.00	0.04
297	605499	东鹏饮料	3,700	639,730.00	0.04
298	300979	华利集团	12,800	623,872.00	0.04
299	601236	红塔证券	79,390	591,455.50	0.04
300	001289	龙源电力	12,700	285,750.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.02
2	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
3	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.01
4	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
5	688443	智翔金泰	2,973	87,673.77	0.01
6	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.01
7	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00

8	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
9	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
10	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
11	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
12	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
13	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
14	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
15	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
16	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
17	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
18	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
19	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
20	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.00
21	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
22	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
23	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
24	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
25	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
26	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
27	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
28	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
29	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
30	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
31	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
32	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
33	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
34	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
35	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
36	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
37	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
38	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
39	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
40	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
41	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
42	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
43	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
44	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
45	601065	江盐集团	802	9,495.68	0.00
46	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
47	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
48	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
49	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
50	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00

51	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
52	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
53	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
54	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
55	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
56	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
57	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
58	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
59	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
60	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
61	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
62	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
63	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
64	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	3,628,509.00	0.22
2	600028	中国石化	3,322,402.00	0.20
3	600941	中国移动	3,124,351.69	0.19
4	600905	三峡能源	2,674,331.00	0.16
5	600732	爱旭股份	2,486,227.00	0.15
6	601899	紫金矿业	2,323,046.00	0.14
7	601607	上海医药	2,205,194.00	0.13
8	688223	晶科能源	2,161,389.24	0.13
9	601318	中国平安	2,078,827.70	0.13
10	601818	光大银行	1,993,963.00	0.12
11	000983	山西焦煤	1,939,203.00	0.12
12	600754	锦江酒店	1,845,497.00	0.11
13	600875	东方电气	1,701,521.00	0.10
14	601699	潞安环能	1,690,726.00	0.10
15	600036	招商银行	1,677,262.00	0.10
16	601872	招商轮船	1,655,023.00	0.10
17	000617	中油资本	1,573,323.00	0.09
18	688249	晶合集成	1,470,454.26	0.09
19	688303	大全能源	1,321,916.32	0.08
20	603501	韦尔股份	1,220,470.00	0.07

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	8,959,780.00	0.54
2	600900	长江电力	4,834,512.00	0.29
3	601318	中国平安	4,496,991.00	0.27
4	600036	招商银行	3,821,626.00	0.23
5	002602	世纪华通	3,367,536.36	0.20
6	601166	兴业银行	2,106,136.00	0.13
7	601012	隆基绿能	2,058,136.60	0.12
8	603882	金域医学	2,022,504.00	0.12
9	002008	大族激光	1,787,529.24	0.11
10	601818	光大银行	1,733,836.00	0.10
11	600887	伊利股份	1,695,906.00	0.10
12	600030	中信证券	1,678,851.64	0.10
13	688169	石头科技	1,638,247.57	0.10
14	600276	恒瑞医药	1,623,847.80	0.10
15	600309	万华化学	1,553,961.00	0.09
16	002600	领益智造	1,520,951.00	0.09
17	601888	中国中免	1,433,117.00	0.09
18	603259	药明康德	1,351,027.00	0.08
19	601398	工商银行	1,326,465.00	0.08
20	688249	晶合集成	1,325,464.28	0.08

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	119,867,641.73
卖出股票收入（成交）总额	152,151,357.07

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚；招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行的处罚；兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行的处罚。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	320,871.01
2	应收清算款	323,279.20
3	应收股利	154,023.80
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	24,560.42
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	822,734.43

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300750	宁德时代	3,889,430.00	0.24	转融通融出

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301486	致尚科技	277,921.20	0.02	新股未上市
2	688249	晶合集成	133,734.30	0.01	新股锁定期
3	688472	阿特斯	106,687.44	0.01	新股锁定期
4	301488	豪恩汽电	93,721.68	0.01	新股未上市
5	301488	豪恩汽电	10,422.36	0.00	新股锁定期
6	688443	智翔金泰	87,673.77	0.01	新股锁定期

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
16,966	49,227.84	7,895,227.00	0.95%	138,514,005.00	16.58%	688,790,219.00	82.47%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	方正证券股份有限公司	2,039,835.00	0.24%
2	刘剑	2,000,000.00	0.24%
3	海通证券股份有限公司	1,832,002.00	0.22%
4	陈淑兰	1,335,154.00	0.16%
5	蔡景玲	1,049,429.00	0.13%
6	徐国忠	1,007,417.00	0.12%
7	郭红霞	900,000.00	0.11%
8	中信证券股份有限公司	881,630.00	0.11%
9	中国人寿保险股份有限公司万能账户（国寿资产受托）	858,575.00	0.10%
10	广发证券股份有限公司	654,288.00	0.08%
11	中国工商银行-南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金	688,790,219.00	82.47%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013 年 2 月 18 日)基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	873,199,451.00
本报告期基金总申购份额	24,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	62,000,000.00
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	835,199,451.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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	
华泰证券	4	137,709,623.98	53.55%	13,772.20	53.55%	-
银河证券	2	119,463,168.00	46.45%	11,946.73	46.45%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	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

退租交易单元：

无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	453,942.02	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-16
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-01
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-22
4	南方基金关于南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金增加国金证券为场内申购赎回代理券商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-24
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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-15
6	南方基金关于旗下部分基金增加东海证券为场内申购赎回代理券商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-27
7	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、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	证券时报、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华宝证券为场内申购赎回代理券商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-11
10	南方基金关于旗下部分基金增加联储证券为场内申购赎回代理券商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-16
11	南方基金关于旗下部分基金增加华福证券为场内申购赎回代理券商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-01
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-03
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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
14	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资	证券时报、基金管理	2023-06-21

	关联方承销证券的关联交易公告	人网站、中国证监会基金电子披露网站	
15	关于南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-27

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20230101-20230630	690,226,219.00	24,746,600.00	26,182,600.00	688,790,219.00	82.47%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 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>