

深证成份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

§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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49

7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方深证成份 ETF
场内简称	深成 ETF
基金主代码	159903
交易代码	159903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 4 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	211,154,507.00 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	2010 年 2 月 2 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>本基金为完全被动式指数基金，原则上采用完全复制法，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。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>存托凭证的投资策略：本基金将根据法律法规和监管机构的要求，制定存托凭证投资策略，关注发行人有关信息披露情况，关注发行人基本面情况、市场估值等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，参与存托凭证的投资，谨慎决定存托凭证的权重配置和标的选择。</p>
业绩比较基准	深证成份指数
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，主要采用完全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	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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	-144,338.56
本期利润	3,008,565.37
加权平均基金份额本期利润	0.0158
本期加权平均净值利润率	1.18%
本期基金份额净值增长率	0.77%
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	-11,579,270.27
期末可供分配基金份额利润	-0.0548
期末基金资产净值	274,591,396.42
期末基金份额净值	1.3004

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	-4.05%

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。

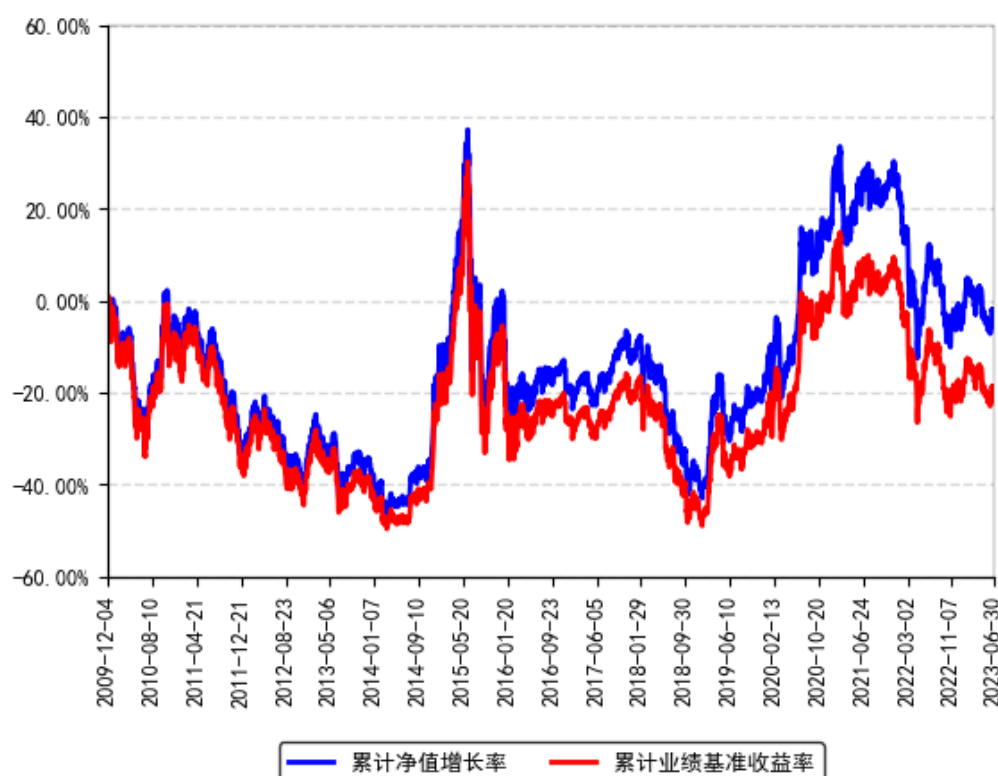
3.2 基金净值表现

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	2.66%	1.06%	2.16%	1.06%	0.50%	0.00%
过去三个月	-5.25%	0.90%	-5.97%	0.90%	0.72%	0.00%
过去六个月	0.77%	0.90%	0.10%	0.90%	0.67%	0.00%
过去一年	-13.76%	1.06%	-14.50%	1.06%	0.74%	0.00%
过去三年	-2.32%	1.33%	-8.05%	1.33%	5.73%	0.00%
自基金合同生效起至今	-4.05%	1.55%	-20.59%	1.57%	16.54%	-0.02%

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

南方深证成份ETF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		
孙伟	本基金 基金经 理	2016 年 8 月 19 日	-	13 年	北京大学工商管理硕士，特许金融分析师（CFA）、注册会计师（CPA），具有基金从业资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员、基金经理助理；2015 年 5 月 22 日至 2016 年 7 月 29 日，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月 2 日至 2020 年 12 月 1 日，任改革基金、高铁基金基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 7 日，任南方中证 500 工业 ETF 基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 14 日，任南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2020 年 12 月 1 日至 2021 年 4 月 19 日，任改革基金基金经理；2015 年 7 月 10 日至今，任 500 信息基金经理；2016 年 5 月 13 日至今，任南方创业板 ETF 基金经理；2016 年 5 月 20 日至今，任南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月 17 日至今，任 500 信息联接基金经理；2016 年 8 月 19 日至今，任深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月 8 日至今，任南方全指证券 ETF 联接基金经理；2017 年 3 月 10 日至今，任南方中证全指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月 28 日至今，任南方中证银行 ETF 基金经理；2017 年 6 月 29 日至今，任南方银行联接基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至今，任南方 H 股联接基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接基金经理；2020 年 12 月 1 日至今，任高铁基金基金经理；2022 年 3 月 3 日至今，任南方上海金 ETF 基金经理。

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

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

4.2 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

深证成指报告期内微涨 0.10%。

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 ETF 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）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；

(3) 根据指数成份股调整进行的基金调仓，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，将跟踪误差控制在理想范围内；

(4) 新股上市初期涨幅较大的影响。

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 1.3004 元，报告期内，份额净值增长率为 0.77%，同期业绩基准增长率为 0.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年以来，国内经济整体呈现弱复苏态势，A 股市场行业和风格间的结构分化剧烈，市场整体存量博弈特征仍然明显。

展望下半年，市场有望迎来向上拐点，主要基于以下三点判断：1、房地产行业将在政策调整下，走出周期性复苏；2、上市公司盈利有望随经济复苏转好，流动性整体维持充裕，风险偏好有望提升；3、股债收益差指标显示权益资产相比固收类资产更具性价比，且权益市场整体估值处于历史相对低位，向上修复空间较大。

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真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 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：深证成份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	874,592.88	177,852.98
结算备付金		17,952.10	4,026.43
存出保证金		418.74	1,286.30
交易性金融资产	6.4.3.2	273,992,091.01	245,435,378.82
其中：股票投资		273,955,487.96	245,435,378.82
基金投资		-	-
债券投资		36,603.05	-
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		10,985.43	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		274,896,040.16	245,618,544.53
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		37,868.98	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		110,632.34	103,058.42
应付托管费		22,126.46	20,611.70
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.01	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	134,015.95	117,473.40
负债合计		304,643.74	241,143.52
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	286,170,666.69	257,710,066.47
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	-11,579,270.27	-12,332,665.46
净资产合计		274,591,396.42	245,377,401.01
负债和净资产总计		274,896,040.16	245,618,544.53

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3004 元，基金份额总额 211,154,507.00 份。

6.2 利润表

会计主体：深证成份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		3,921,884.30	-35,271,989.38
1.利息收入		940.94	1,070.81
其中：存款利息收入	6.4.3.9	940.94	1,070.81
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		768,633.13	3,622,590.04
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-1,823,823.32	1,494,193.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	24,382.46	20,482.64
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.12	-	-
衍生工具收益	6.4.3.13	-	-
股利收益	6.4.3.14	2,568,073.99	2,107,913.75
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）	6.4.3.15	3,152,903.93	-38,898,503.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-593.70	2,853.14
减：二、营业总支出		913,318.93	913,351.88
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	632,353.68	632,356.03
2.托管费	6.4.6.2.2	126,470.69	126,471.20
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		-	0.09
8.其他费用	6.4.3.17	154,494.56	154,524.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,008,565.37	-36,185,341.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,008,565.37	-36,185,341.26
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,008,565.37	-36,185,341.26

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：深证成份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、上期期末净资产（基金净值）	257,710,066.47	-	-12,332,665.46	245,377,401.01
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	257,710,066.47	-	-12,332,665.46	245,377,401.01

资产(基金净值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	28,460,600.22	-	753,395.19	29,213,995.41
(一)、综合收益总额	-	-	3,008,565.37	3,008,565.37
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	28,460,600.22	-	-2,255,170.18	26,205,430.04
其中: 1.基金申购款	52,855,400.39	-	-2,282,895.51	50,572,504.88
2.基金赎回款	-24,394,800.17	-	27,725.33	-24,367,074.84
(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)	286,170,666.69	-	-11,579,270.27	274,591,396.42
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)	233,315,266.29	-	64,052,859.93	297,368,126.22
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)	233,315,266.29	-	64,052,859.93	297,368,126.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	8,131,600.07	-	-36,883,760.16	-28,752,160.09
(一)、综合收益总额	-	-	-36,185,341.26	-36,185,341.26
(二)、本期基金份额交易产生的	8,131,600.07	-	-698,418.90	7,433,181.17

基金净值变动数 (净值减少以“-” 号填列)				
其中：1.基金申 购款	40,658,000.27	-	3,557,355.71	44,215,355.98
2.基金赎 回款	-32,526,400.20	-	-4,255,774.61	-36,782,174.81
(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)	241,446,866.36	-	27,169,099.77	268,615,966.13

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	874,592.88
等于：本金	874,518.86
加：应计利息	74.02
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	874,592.88

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	284,479,711.43	-	273,955,487.96	-10,524,223.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	36,600.00	36,603.05	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	36,600.00	36,603.05	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	284,516,311.43	3.05	273,992,091.01	-10,524,223.47

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

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,653.56
其中：交易所市场	1,653.56
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	10,240.63
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	35,000.00
可退替代款	2,819.20
其他	-
合计	134,015.95

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	190,154,507.00	257,710,066.47
本期申购	39,000,000.00	52,855,400.39
本期赎回（以“-”号填列）	-18,000,000.00	-24,394,800.17
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	211,154,507.00	286,170,666.69

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

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	144,171,229.00	-156,503,894.46	-12,332,665.46
本期利润	-144,338.56	3,152,903.93	3,008,565.37
本期基金份额交易产生的变动数	15,957,202.14	-18,212,372.32	-2,255,170.18
其中：基金申购款	29,596,706.71	-31,879,602.22	-2,282,895.51
基金赎回款	-13,639,504.57	13,667,229.90	27,725.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	159,984,092.58	-171,563,362.85	-11,579,270.27

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	834.91
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	101.14
其他	4.89
合计	940.94

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	-1,784,554.65
股票投资收益——赎回差价收入	-39,268.67
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	-1,823,823.32

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	8,505,504.32
减：卖出股票成本总额	10,278,314.95
减：交易费用	11,744.02
买卖股票差价收入	-1,784,554.65

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	24,367,074.84
减：现金支付赎回款总额	24,252.84
减：赎回股票成本总额	24,382,090.67
减：交易费用	-
赎回差价收入	-39,268.67

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	15.55
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	24,366.91
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	24,382.46

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	115,084.02
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	90,700.00
减：应计利息总额	12.51
减：交易费用	4.60
买卖债券差价收入	24,366.91

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 贵金属投资收益

6.4.3.12.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：上述交易费用（如有）包含贵金属买卖产生的交易费用。

6.4.3.13 衍生工具收益

6.4.3.13.1 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。

6.4.3.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.3.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,568,073.99
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,568,073.99

6.4.3.15 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	3,152,903.93
——股票投资	3,152,903.93
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,152,903.93

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。

6.4.3.16 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	-593.70
合计	-593.70

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。

6.4.3.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00
银行费用	192.00
合计	154,494.56

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
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
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金("南方深成 ETF 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

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股票交易。

6.4.6.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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	632,353.68	632,356.03
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	126,470.69	126,471.20

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

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

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

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

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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	873,424.00	0.41%	517,200.00	0.27%
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	117,826,474.00	55.80%	112,765,374.00	59.30%

注：华泰证券和南方深成 ETF 联接基金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	874,592.88	834.91	776,379.92	791.03

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	127084	柳工转 2	配债	327	32,700.00

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	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	301207	华兰疫苗	网下申购	1,798	102,270.24
华泰联合	123145	药石转债	配债	190	19,000.00

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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
127086	恒邦转债	2023 年 6 月 12 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.01	366	36,600.00	36,603.05	-

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

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

300346	南大光电	2023 年 6 月 26 日	重大事项停牌	34.39	2023 年 7 月 6 日	35.60	10,890	335,270.41	374,507.10	-
000540	*ST 中天	2023 年 5 月 19 日	退市	0.14	-	-	100,100	332,602.15	14,014.00	-

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

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪深证成份指数，具有和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，跟踪深证成份指数，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,将风险控制可在可承受的范围内。

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,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。

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综合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外,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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	874,592.88	-	-	-	874,592.88
结算备付金	17,952.10	-	-	-	17,952.10
存出保证金	418.74	-	-	-	418.74
交易性金融资产	-	-	36,603.05	273,955,487.96	273,992,091.01
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	-	-	-	10,985.43	10,985.43
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	892,963.72	-	36,603.05	273,966,473.39	274,896,040.16
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	-	-	-	37,868.98	37,868.98
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	110,632.34	110,632.34
应付托管费	-	-	-	22,126.46	22,126.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.01	0.01
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	134,015.95	134,015.95
负债总计	-	-	-	304,643.74	304,643.74
利率敏感度缺口	892,963.72	-	36,603.05	273,661,829.65	274,591,396.42
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	177,852.98	-	-	-	177,852.98
结算备付金	4,026.43	-	-	-	4,026.43
存出保证金	1,286.30	-	-	-	1,286.30
交易性金融	-	-	-	245,435,378.	245,435,378.

资产				82	82
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	183,165.71	-	-	245,435,378.82	245,618,544.53
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	103,058.42	103,058.42
应付托管费	-	-	-	20,611.70	20,611.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	117,473.40	117,473.40
负债总计	-	-	-	241,143.52	241,143.52
利率敏感度缺口	183,165.71	-	-	245,194,235.30	245,377,401.01

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	-522.01	0.00
	2.市场利率平行下降 25 个基点	530.92	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和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法跟踪深证成份指数，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，深证成份指数成份股和备选成份股股票以及存托凭证投资比例不低于基金资产净值的 95%，新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例不高于基金资产净值的 5%。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	273,955,487.96	99.77	245,435,378.82	100.02
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	273,955,487.96	99.77	245,435,378.82	100.02

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%	13,660,585.86	12,219,953.26
	2.组合自身基准下降 5%	-13,660,585.86	-12,219,953.26

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	273,566,966.86
第二层次	411,110.15
第三层次	14,014.00
合计	273,992,091.01

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、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

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 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	273,955,487.96	99.66
	其中：股票	273,955,487.96	99.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	36,603.05	0.01
	其中：债券	36,603.05	0.01
	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	892,544.98	0.32
8	其他资产	11,404.17	0.00
9	合计	274,896,040.16	100.00

注：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。

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	5,896,059.20	2.15
B	采矿业	2,790,575.80	1.02

C	制造业	203,550,557.47	74.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,121,236.60	1.14
E	建筑业	478,849.26	0.17
F	批发和零售业	2,060,441.09	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	3,708,336.63	1.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,702,911.80	6.45
J	金融业	18,227,402.98	6.64
K	房地产业	3,969,672.33	1.45
L	租赁和商务服务业	3,061,271.54	1.11
M	科学研究和技术服务业	2,753,837.00	1.00
N	水利、环境和公共设施管理业	762,050.14	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	407,490.00	0.15
Q	卫生和社会工作	2,921,190.04	1.06
R	文化、体育和娱乐业	2,067,261.49	0.75
S	综合	462,486.19	0.17
	合计	273,941,629.56	99.76

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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	14,014.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	14,014.00	0.01

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

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	300750	宁德时代	59,940	13,713,672.60	4.99
2	000858	五粮液	43,541	7,122,001.37	2.59
3	000333	美的集团	117,242	6,907,898.64	2.52
4	002594	比亚迪	20,436	5,278,005.72	1.92
5	300059	东方财富	297,981	4,231,330.20	1.54
6	000651	格力电器	106,840	3,900,728.40	1.42
7	000568	泸州老窖	17,892	3,749,626.44	1.37
8	002475	立讯精密	109,108	3,540,554.60	1.29
9	300760	迈瑞医疗	11,800	3,537,640.00	1.29
10	000063	中兴通讯	75,233	3,426,110.82	1.25
11	000725	京东方 A	764,642	3,127,385.78	1.14
12	002415	海康威视	90,981	3,012,380.91	1.10
13	300124	汇川技术	45,791	2,940,240.11	1.07
14	002230	科大讯飞	42,170	2,865,873.20	1.04
15	300274	阳光电源	23,935	2,791,539.05	1.02
16	002352	顺丰控股	56,283	2,537,800.47	0.92
17	002714	牧原股份	59,303	2,499,621.45	0.91
18	300498	温氏股份	127,409	2,337,955.15	0.85
19	002129	TCL 中环	70,400	2,337,280.00	0.85
20	000001	平安银行	203,012	2,279,824.76	0.83
21	002142	宁波银行	84,711	2,143,188.30	0.78
22	300308	中际旭创	14,460	2,132,127.00	0.78
23	000002	万科 A	146,858	2,058,949.16	0.75
24	002371	北方华创	6,400	2,032,960.00	0.74
25	002304	洋河股份	14,261	1,873,182.35	0.68
26	300015	爱尔眼科	98,088	1,819,532.40	0.66
27	300014	亿纬锂能	29,851	1,805,985.50	0.66
28	000792	盐湖股份	92,700	1,777,059.00	0.65
29	002466	天齐锂业	24,700	1,726,777.00	0.63
30	002027	分众传媒	241,696	1,645,949.76	0.60
31	002460	赣锋锂业	26,860	1,637,385.60	0.60

32	002459	晶澳科技	37,376	1,558,579.20	0.57
33	000338	潍柴动力	123,408	1,537,663.68	0.56
34	002049	紫光国微	15,578	1,452,648.50	0.53
35	000100	TCL 科技	359,278	1,415,555.32	0.52
36	002050	三花智控	44,960	1,360,489.60	0.50
37	000938	紫光股份	41,558	1,323,622.30	0.48
38	000625	长安汽车	100,236	1,296,051.48	0.47
39	002271	东方雨虹	45,963	1,252,951.38	0.46
40	002555	三七互娱	35,800	1,248,704.00	0.45
41	002179	中航光电	26,286	1,192,070.10	0.43
42	002812	恩捷股份	12,280	1,183,178.00	0.43
43	002709	天赐材料	28,612	1,178,528.28	0.43
44	300122	智飞生物	26,450	1,169,090.00	0.43
45	000977	浪潮信息	23,286	1,129,371.00	0.41
46	002241	歌尔股份	58,710	1,042,102.50	0.38
47	300316	晶盛机电	14,610	1,035,849.00	0.38
48	300142	沃森生物	39,100	1,034,195.00	0.38
49	002410	广联达	31,047	1,008,717.03	0.37
50	300502	新易盛	14,747	1,002,353.59	0.37
51	000776	广发证券	66,759	982,024.89	0.36
52	000661	长春高新	7,200	981,360.00	0.36
53	000166	申万宏源	211,269	976,062.78	0.36
54	002602	世纪华通	127,351	966,594.09	0.35
55	300896	爱美客	2,100	934,395.00	0.34
56	002920	德赛西威	5,700	888,117.00	0.32
57	001979	招商蛇口	67,527	879,876.81	0.32
58	002311	海大集团	18,740	877,781.60	0.32
59	300408	三环集团	29,600	868,760.00	0.32
60	002252	上海莱士	114,440	859,444.40	0.31
61	300450	先导智能	23,699	857,192.83	0.31
62	000538	云南白药	16,120	845,977.60	0.31
63	002493	荣盛石化	72,525	844,191.00	0.31
64	300033	同花顺	4,800	841,344.00	0.31
65	000733	振华科技	8,700	833,895.00	0.30
66	300347	泰格医药	12,900	832,566.00	0.30
67	000768	中航西飞	30,990	828,982.50	0.30
68	000596	古井贡酒	3,339	826,001.82	0.30
69	002236	大华股份	41,778	825,115.50	0.30
70	002340	格林美	115,300	796,723.00	0.29
71	300496	中科创达	8,254	795,272.90	0.29
72	000425	徐工机械	117,208	793,498.16	0.29
73	000963	华东医药	18,295	793,454.15	0.29
74	002384	东山精密	30,400	787,360.00	0.29

75	300782	卓胜微	7,986	771,687.18	0.28
76	000988	华工科技	20,000	760,200.00	0.28
77	002180	纳思达	21,600	739,800.00	0.27
78	300418	昆仑万维	18,200	733,096.00	0.27
79	000157	中联重科	107,227	723,782.25	0.26
80	002422	科伦药业	24,278	720,571.04	0.26
81	002074	国轩高科	24,900	687,738.00	0.25
82	300724	捷佳伟创	6,000	674,100.00	0.25
83	002517	恺英网络	42,700	672,098.00	0.24
84	002202	金风科技	63,113	670,260.06	0.24
85	300003	乐普医疗	29,300	662,473.00	0.24
86	000066	中国长城	47,838	661,599.54	0.24
87	002463	沪电股份	31,420	657,934.80	0.24
88	300012	华测检测	33,500	653,250.00	0.24
89	002738	中矿资源	12,480	635,731.20	0.23
90	000807	云铝股份	49,900	635,227.00	0.23
91	300454	深信服	5,600	634,200.00	0.23
92	002028	思源电气	13,500	630,720.00	0.23
93	000895	双汇发展	25,524	625,082.76	0.23
94	002648	卫星化学	41,401	619,358.96	0.23
95	300223	北京君正	7,000	618,170.00	0.23
96	002821	凯莱英	5,240	617,586.40	0.22
97	002405	四维图新	52,296	605,587.68	0.22
98	300037	新宙邦	11,500	596,735.00	0.22
99	300661	圣邦股份	7,236	594,292.68	0.22
100	002601	龙佰集团	36,000	594,000.00	0.22
101	000876	新希望	50,752	592,783.36	0.22
102	000301	东方盛虹	49,600	586,272.00	0.21
103	002001	新和成	37,828	582,551.20	0.21
104	000423	东阿阿胶	10,871	581,054.95	0.21
105	002156	通富微电	25,480	575,848.00	0.21
106	002736	国信证券	65,600	572,688.00	0.21
107	002185	华天科技	62,074	571,080.80	0.21
108	300751	迈为股份	3,358	568,778.04	0.21
109	002472	双环传动	15,600	566,280.00	0.21
110	300146	汤臣倍健	23,600	565,928.00	0.21
111	002841	视源股份	8,400	561,456.00	0.20
112	002558	巨人网络	30,900	554,037.00	0.20
113	300769	德方纳米	5,024	553,795.52	0.20
114	002436	兴森科技	35,700	553,350.00	0.20
115	300058	蓝色光标	57,034	551,518.78	0.20
116	300433	蓝思科技	46,358	545,170.08	0.20
117	002007	华兰生物	24,230	542,994.30	0.20

118	300999	金龙鱼	13,558	542,184.42	0.20
119	300207	欣旺达	33,000	538,560.00	0.20
120	000786	北新建材	21,900	536,769.00	0.20
121	000999	华润三九	8,800	533,808.00	0.19
122	002797	第一创业	91,040	520,748.80	0.19
123	003816	中国广核	167,100	519,681.00	0.19
124	300759	康龙化成	13,550	518,694.00	0.19
125	002008	大族激光	19,700	516,140.00	0.19
126	000975	银泰黄金	43,904	513,676.80	0.19
127	002223	鱼跃医疗	14,200	511,058.00	0.19
128	300285	国瓷材料	18,650	511,010.00	0.19
129	002624	完美世界	30,150	509,233.50	0.19
130	300763	锦浪科技	4,865	506,446.50	0.18
131	300413	芒果超媒	14,800	506,308.00	0.18
132	002625	光启技术	33,090	504,953.40	0.18
133	000799	酒鬼酒	5,600	504,840.00	0.18
134	002385	大北农	76,250	503,250.00	0.18
135	002044	美年健康	69,756	495,965.16	0.18
136	000783	长江证券	85,019	493,110.20	0.18
137	002966	苏州银行	74,880	490,464.00	0.18
138	002439	启明星辰	16,300	485,088.00	0.18
139	300073	当升科技	9,600	483,168.00	0.18
140	300395	菲利华	9,800	482,160.00	0.18
141	300474	景嘉微	5,350	481,446.50	0.18
142	002409	雅克科技	6,600	481,008.00	0.18
143	000630	铜陵有色	165,900	479,451.00	0.17
144	000933	神火股份	36,700	477,100.00	0.17
145	002603	以岭药业	18,520	475,778.80	0.17
146	300568	星源材质	27,427	471,470.13	0.17
147	002600	领益智造	67,400	465,734.00	0.17
148	000009	中国宝安	38,317	462,486.19	0.17
149	000021	深科技	23,100	461,769.00	0.17
150	002568	百润股份	12,700	461,645.00	0.17
151	300024	机器人	27,690	461,592.30	0.17
152	000932	华菱钢铁	96,440	460,018.80	0.17
153	002756	永兴材料	7,320	458,305.20	0.17
154	300253	卫宁健康	41,923	453,606.86	0.17
155	000723	美锦能源	59,400	447,876.00	0.16
156	002407	多氟多	22,460	446,055.60	0.16
157	000683	远兴能源	61,800	444,342.00	0.16
158	300390	天华新能	12,380	443,204.00	0.16
159	300567	精测电子	4,650	442,447.50	0.16
160	002176	江特电机	36,400	433,888.00	0.16

161	002497	雅化集团	24,400	433,832.00	0.16
162	300459	汤姆猫	66,789	433,460.61	0.16
163	000831	中国稀土	14,600	432,160.00	0.16
164	300144	宋城演艺	34,826	431,842.40	0.16
165	000591	太阳能	63,400	429,852.00	0.16
166	300919	中伟股份	7,100	427,775.00	0.16
167	002465	海格通信	41,100	424,974.00	0.15
168	000983	山西焦煤	46,420	422,422.00	0.15
169	002025	航天电器	6,590	420,442.00	0.15
170	300832	新产业	7,100	418,900.00	0.15
171	000617	中油资本	57,900	418,617.00	0.15
172	000728	国元证券	63,605	414,704.60	0.15
173	002850	科达利	3,100	409,975.00	0.15
174	002607	中公教育	86,700	407,490.00	0.15
175	000818	航锦科技	12,200	407,114.00	0.15
176	300054	鼎龙股份	16,400	405,572.00	0.15
177	000069	华侨城 A	90,749	399,295.60	0.15
178	000738	航发控制	16,350	398,940.00	0.15
179	300118	东方日升	15,500	397,265.00	0.14
180	002078	太阳纸业	37,100	396,599.00	0.14
181	300604	长川科技	8,300	394,167.00	0.14
182	002368	太极股份	9,559	393,544.03	0.14
183	300699	光威复材	12,592	388,463.20	0.14
184	000860	顺鑫农业	11,520	388,108.80	0.14
185	300136	信维通信	19,260	386,740.80	0.14
186	300628	亿联网络	11,020	386,471.40	0.14
187	002262	恩华药业	12,500	385,375.00	0.14
188	002865	钧达股份	2,497	380,867.41	0.14
189	000408	藏格矿业	16,800	379,176.00	0.14
190	300777	中简科技	8,000	378,080.00	0.14
191	002138	顺络电子	15,800	377,778.00	0.14
192	000998	隆平高科	24,600	377,610.00	0.14
193	002268	电科网安	13,500	376,245.00	0.14
194	002673	西部证券	59,154	375,627.90	0.14
195	000878	云南铜业	33,896	374,550.80	0.14
196	002430	杭氧股份	10,900	374,524.00	0.14
197	300346	南大光电	10,890	374,507.10	0.14
198	300601	康泰生物	14,700	373,233.00	0.14
199	002444	巨星科技	16,900	369,772.00	0.13
200	002195	二三四五	126,705	366,177.45	0.13
201	300487	蓝晓科技	5,850	365,157.00	0.13
202	002152	广电运通	30,800	360,976.00	0.13
203	300438	鹏辉能源	7,500	360,300.00	0.13

204	000519	中兵红箭	19,900	359,991.00	0.13
205	300595	欧普康视	11,820	356,845.80	0.13
206	002353	杰瑞股份	14,187	356,519.31	0.13
207	002281	光迅科技	9,600	356,064.00	0.13
208	002065	东华软件	50,400	355,824.00	0.13
209	000729	燕京啤酒	28,500	355,395.00	0.13
210	000400	许继电气	15,400	354,970.00	0.13
211	000960	锡业股份	22,800	354,540.00	0.13
212	300383	光环新网	32,800	352,600.00	0.13
213	000513	丽珠集团	9,060	352,524.60	0.13
214	002294	信立泰	11,300	352,447.00	0.13
215	002938	鹏鼎控股	14,500	352,205.00	0.13
216	002747	埃斯顿	12,500	350,000.00	0.13
217	002739	万达电影	27,900	349,866.00	0.13
218	002056	横店东磁	19,200	349,632.00	0.13
219	300017	网宿科技	48,645	345,865.95	0.13
220	002916	深南电路	4,572	344,591.64	0.13
221	000629	钒钛股份	88,100	344,471.00	0.13
222	002273	水晶光电	28,754	343,322.76	0.13
223	300866	安克创新	3,900	341,250.00	0.12
224	002595	豪迈科技	9,700	340,761.00	0.12
225	000997	新大陆	17,980	339,822.00	0.12
226	002373	千方科技	24,900	339,636.00	0.12
227	002456	欧菲光	60,502	338,811.20	0.12
228	002080	中材科技	16,510	338,785.20	0.12
229	300476	胜宏科技	14,000	337,540.00	0.12
230	300676	华大基因	5,600	335,944.00	0.12
231	002507	涪陵榨菜	18,240	333,974.40	0.12
232	000623	吉林敖东	20,618	330,712.72	0.12
233	002531	天顺风能	21,700	330,491.00	0.12
234	000032	深桑达 A	10,000	329,000.00	0.12
235	300001	特锐德	15,800	328,324.00	0.12
236	002192	融捷股份	4,900	327,467.00	0.12
237	300182	捷成股份	51,859	327,230.29	0.12
238	300633	开立医疗	6,000	327,000.00	0.12
239	300212	易华录	9,800	325,654.00	0.12
240	002402	和而泰	19,000	322,620.00	0.12
241	000708	中信特钢	20,230	320,443.20	0.12
242	000703	恒逸石化	47,178	319,866.84	0.12
243	000516	国际医学	37,900	318,739.00	0.12
244	002203	海亮股份	26,500	318,265.00	0.12
245	000690	宝新能源	45,300	318,006.00	0.12
246	002851	麦格米特	8,700	317,289.00	0.12

247	002131	利欧股份	137,743	316,808.90	0.12
248	002683	广东宏大	10,700	315,008.00	0.11
249	000547	航天发展	31,300	313,000.00	0.11
250	300666	江丰电子	4,600	312,616.00	0.11
251	300296	利亚德	47,650	311,154.50	0.11
252	002389	航天彩虹	13,800	306,498.00	0.11
253	300682	朗新科技	13,150	306,132.00	0.11
254	002120	韵达股份	31,861	304,591.16	0.11
255	000039	中集集团	44,090	303,780.10	0.11
256	002557	洽洽食品	7,300	303,315.00	0.11
257	000762	西藏矿业	10,200	302,226.00	0.11
258	002506	协鑫集成	102,800	301,204.00	0.11
259	002414	高德红外	38,720	300,854.40	0.11
260	002372	伟星新材	14,520	298,240.80	0.11
261	002092	中泰化学	46,000	296,700.00	0.11
262	002532	天山铝业	49,200	294,708.00	0.11
263	300088	长信科技	48,804	294,288.12	0.11
264	300558	贝达药业	6,100	292,983.00	0.11
265	000970	中科三环	22,770	291,911.40	0.11
266	300458	全志科技	10,692	291,357.00	0.11
267	002926	华西证券	34,800	289,188.00	0.11
268	002151	北斗星通	8,200	288,312.00	0.10
269	300244	迪安诊断	11,196	286,953.48	0.10
270	000893	亚钾国际	12,500	286,750.00	0.10
271	300803	指南针	5,900	286,681.00	0.10
272	000060	中金岭南	59,845	284,263.75	0.10
273	002064	华峰化学	41,400	284,004.00	0.10
274	300456	赛微电子	11,600	283,968.00	0.10
275	000636	风华高科	18,500	283,790.00	0.10
276	300373	扬杰科技	6,960	282,367.20	0.10
277	000750	国海证券	84,125	281,818.75	0.10
278	002508	老板电器	11,060	279,707.40	0.10
279	000155	川能动力	19,300	277,920.00	0.10
280	300251	光线传媒	33,720	272,794.80	0.10
281	002299	圣农发展	14,200	271,930.00	0.10
282	000877	天山股份	33,300	271,062.00	0.10
283	002153	石基信息	19,298	270,172.00	0.10
284	300748	金力永磁	9,000	269,280.00	0.10
285	002617	露笑科技	34,100	268,708.00	0.10
286	300034	钢研高纳	6,800	267,852.00	0.10
287	300957	贝泰妮	3,000	266,640.00	0.10
288	002015	协鑫能科	19,600	263,228.00	0.10
289	002500	山西证券	46,580	259,916.40	0.09

290	000739	普洛药业	14,600	259,004.00	0.09
291	002936	郑州银行	112,491	258,729.30	0.09
292	002484	江海股份	12,100	257,609.00	0.09
293	002939	长城证券	31,600	256,908.00	0.09
294	002541	鸿路钢构	8,900	256,409.00	0.09
295	000921	海信家电	9,500	256,025.00	0.09
296	000830	鲁西化工	24,100	254,496.00	0.09
297	002019	亿帆医药	17,400	254,040.00	0.09
298	000887	中鼎股份	19,400	253,946.00	0.09
299	300009	安科生物	25,367	253,670.00	0.09
300	000050	深天马 A	27,600	253,368.00	0.09
301	002245	蔚蓝锂芯	23,000	251,850.00	0.09
302	002429	兆驰股份	45,200	248,600.00	0.09
303	002128	电投能源	18,800	248,536.00	0.09
304	300294	博雅生物	6,850	248,518.00	0.09
305	002317	众生药业	14,600	248,054.00	0.09
306	002958	青农商行	90,600	246,432.00	0.09
307	000875	吉电股份	45,700	246,323.00	0.09
308	002145	中核钛白	41,785	246,113.65	0.09
309	002396	星网锐捷	10,800	243,972.00	0.09
310	002212	天融信	25,100	243,470.00	0.09
311	300026	红日药业	44,800	242,816.00	0.09
312	000951	中国重汽	14,340	241,629.00	0.09
313	000778	新兴铸管	58,832	240,034.56	0.09
314	300529	健帆生物	10,300	238,754.00	0.09
315	300451	创业慧康	28,445	238,369.10	0.09
316	002030	达安基因	23,781	237,096.57	0.09
317	300775	三角防务	7,000	236,460.00	0.09
318	301236	软通动力	8,650	235,366.50	0.09
319	002155	湖南黄金	19,200	234,240.00	0.09
320	300363	博腾股份	7,900	233,761.00	0.09
321	301269	华大九天	1,900	233,396.00	0.08
322	300638	广和通	10,260	232,696.80	0.08
323	002643	万润股份	13,350	232,423.50	0.08
324	000686	东北证券	33,400	231,796.00	0.08
325	002487	大金重工	7,500	231,300.00	0.08
326	002244	滨江集团	26,100	230,202.00	0.08
327	300674	宇信科技	12,900	228,072.00	0.08
328	000528	柳工	28,860	227,994.00	0.08
329	300070	碧水源	42,534	227,982.24	0.08
330	002326	永太科技	14,900	227,821.00	0.08
331	300677	英科医疗	10,320	227,040.00	0.08
332	002408	齐翔腾达	35,520	226,262.40	0.08

333	002266	浙富控股	54,330	224,382.90	0.08
334	002518	科士达	5,600	224,056.00	0.08
335	002706	良信股份	19,900	223,875.00	0.08
336	300747	锐科激光	7,310	222,808.80	0.08
337	300115	长盈精密	18,688	222,574.08	0.08
338	300773	拉卡拉	12,700	221,488.00	0.08
339	002831	裕同科技	9,080	221,461.20	0.08
340	002572	索菲亚	12,464	217,122.88	0.08
341	002249	大洋电机	38,034	216,793.80	0.08
342	300357	我武生物	6,440	216,577.20	0.08
343	002183	怡亚通	42,140	214,914.00	0.08
344	002675	东诚药业	14,600	214,766.00	0.08
345	000403	派林生物	10,700	213,572.00	0.08
346	002585	双星新材	16,800	211,008.00	0.08
347	000709	河钢股份	92,800	209,728.00	0.08
348	002727	一心堂	7,800	205,920.00	0.07
349	000810	创维数字	12,700	205,359.00	0.07
350	002099	海翔药业	23,900	205,301.00	0.07
351	300679	电连技术	6,200	204,910.00	0.07
352	002312	川发龙蟒	25,100	204,063.00	0.07
353	300776	帝尔激光	3,123	202,682.70	0.07
354	000027	深圳能源	30,640	201,917.60	0.07
355	000825	太钢不锈	51,900	200,853.00	0.07
356	300432	富临精工	17,200	199,864.00	0.07
357	002221	东华能源	23,100	199,815.00	0.07
358	000883	湖北能源	43,700	199,272.00	0.07
359	000581	威孚高科	12,551	197,678.25	0.07
360	300888	稳健医疗	4,740	197,515.80	0.07
361	300298	三诺生物	7,300	197,392.00	0.07
362	001227	兰州银行	68,700	196,482.00	0.07
363	002984	森麒麟	6,200	195,052.00	0.07
364	001965	招商公路	20,200	193,920.00	0.07
365	002085	万丰奥威	27,928	193,541.04	0.07
366	000012	南玻 A	32,446	193,378.16	0.07
367	300672	国科微	2,300	191,705.00	0.07
368	002701	奥瑞金	42,500	191,675.00	0.07
369	002985	北摩高科	4,321	190,642.52	0.07
370	300725	药石科技	3,930	190,329.90	0.07
371	002690	美亚光电	7,350	189,262.50	0.07
372	003022	联泓新科	7,600	189,240.00	0.07
373	301050	雷电微力	2,900	188,297.00	0.07
374	000422	湖北宜化	16,200	185,976.00	0.07
375	000028	国药一致	4,200	183,162.00	0.07

376	002791	坚朗五金	2,800	181,188.00	0.07
377	000035	中国天楹	39,500	180,910.00	0.07
378	300979	华利集团	3,700	180,338.00	0.07
379	003035	南网能源	25,200	179,424.00	0.07
380	002745	木林森	19,500	179,400.00	0.07
381	000156	华数传媒	20,600	179,220.00	0.07
382	002511	中顺洁柔	16,000	178,400.00	0.06
383	000401	冀东水泥	24,164	178,088.68	0.06
384	000785	居然之家	46,700	177,927.00	0.06
385	002597	金禾实业	7,500	177,000.00	0.06
386	002004	华邦健康	35,400	177,000.00	0.06
387	002250	联化科技	16,900	176,774.00	0.06
388	300035	中科电气	14,600	175,492.00	0.06
389	300618	寒锐钴业	5,344	173,199.04	0.06
390	003031	中瓷电子	1,300	173,056.00	0.06
391	002867	周大生	9,725	172,910.50	0.06
392	000987	越秀资本	26,686	169,456.10	0.06
393	000598	兴蓉环境	31,100	168,873.00	0.06
394	002091	江苏国泰	22,300	168,142.00	0.06
395	000555	神州信息	13,500	166,050.00	0.06
396	300910	瑞丰新材	3,300	165,990.00	0.06
397	300861	美畅股份	3,820	165,673.40	0.06
398	300376	易事特	24,700	165,490.00	0.06
399	000930	中粮科技	20,400	165,240.00	0.06
400	002032	苏泊尔	3,300	165,000.00	0.06
401	301035	润丰股份	2,100	164,997.00	0.06
402	300850	新强联	4,400	164,472.00	0.06
403	300482	万孚生物	6,170	164,307.10	0.06
404	002127	南极电商	42,600	163,158.00	0.06
405	002124	天邦食品	35,900	162,986.00	0.06
406	000800	一汽解放	19,300	161,541.00	0.06
407	002468	申通快递	14,900	161,218.00	0.06
408	000559	万向钱潮	29,540	160,993.00	0.06
409	300623	捷捷微电	8,800	159,456.00	0.06
410	000937	冀中能源	24,900	158,862.00	0.06
411	300685	艾德生物	6,440	156,234.40	0.06
412	300463	迈克生物	10,300	155,736.00	0.06
413	301268	铭利达	3,700	154,919.00	0.06
414	301155	海力风电	2,000	154,160.00	0.06
415	000415	渤海租赁	73,360	154,056.00	0.06
416	002010	传化智联	28,900	153,748.00	0.06
417	000902	新洋丰	14,902	153,192.56	0.06
418	002773	康弘药业	7,990	152,768.80	0.06

419	000089	深圳机场	21,900	152,205.00	0.06
420	002505	鹏都农牧	79,810	150,840.90	0.05
421	002081	金螳螂	33,226	149,849.26	0.05
422	002048	宁波华翔	11,100	148,740.00	0.05
423	001914	招商积余	9,800	147,490.00	0.05
424	000539	粤电力 A	20,200	147,460.00	0.05
425	300457	赢合科技	8,300	146,578.00	0.05
426	002237	恒邦股份	13,300	144,837.00	0.05
427	000898	鞍钢股份	52,069	144,751.82	0.05
428	300257	开山股份	9,300	141,081.00	0.05
429	300737	科顺股份	15,200	139,232.00	0.05
430	002423	中粮资本	17,400	139,200.00	0.05
431	301071	力量钻石	3,160	139,040.00	0.05
432	300171	东富龙	6,100	138,775.00	0.05
433	300726	宏达电子	3,100	138,632.00	0.05
434	000712	锦龙股份	11,100	138,528.00	0.05
435	002191	劲嘉股份	22,975	138,309.50	0.05
436	002948	青岛银行	43,790	137,062.70	0.05
437	002906	华阳集团	3,900	133,341.00	0.05
438	002705	新宝股份	7,300	131,619.00	0.05
439	000563	陕国投 A	43,130	131,546.50	0.05
440	002041	登海种业	8,600	131,322.00	0.05
441	000958	电投产融	30,200	130,766.00	0.05
442	002626	金达威	6,900	129,651.00	0.05
443	000967	盈峰环境	25,500	128,775.00	0.05
444	000537	广宇发展	11,000	128,370.00	0.05
445	000402	金融街	27,763	125,488.76	0.05
446	002925	盈趣科技	6,430	124,742.00	0.05
447	000627	天茂集团	41,400	124,200.00	0.05
448	000927	中国铁物	44,200	122,876.00	0.04
449	002434	万里扬	13,700	122,615.00	0.04
450	002967	广电计量	6,100	122,549.00	0.04
451	300630	普利制药	6,263	122,441.65	0.04
452	002216	三全食品	7,640	119,031.20	0.04
453	002670	国盛金控	13,360	117,300.80	0.04
454	000966	长源电力	21,000	117,180.00	0.04
455	300761	立华股份	6,220	114,634.60	0.04
456	000959	首钢股份	32,300	113,050.00	0.04
457	002608	江苏国信	14,800	112,036.00	0.04
458	301078	孩子王	9,800	112,014.00	0.04
459	301047	义翘神州	1,300	111,410.00	0.04
460	002498	汉缆股份	27,600	110,676.00	0.04
461	301029	怡合达	2,472	110,448.96	0.04

462	300973	立高食品	1,600	109,472.00	0.04
463	002612	朗姿股份	4,600	109,388.00	0.04
464	001203	大中矿业	9,800	108,878.00	0.04
465	002110	三钢闽光	25,750	108,665.00	0.04
466	300428	立中集团	4,700	108,382.00	0.04
467	000990	诚志股份	14,100	107,442.00	0.04
468	002563	森马服饰	17,200	106,984.00	0.04
469	002653	海思科	4,500	106,200.00	0.04
470	300841	康华生物	1,600	105,424.00	0.04
471	000688	国城矿业	6,900	104,673.00	0.04
472	000935	四川双马	5,900	99,356.00	0.04
473	301219	腾远钴业	2,600	97,136.00	0.04
474	001872	招商港口	5,500	94,985.00	0.03
475	002242	九阳股份	6,200	92,690.00	0.03
476	000672	上峰水泥	10,040	91,665.20	0.03
477	002945	华林证券	6,700	91,656.00	0.03
478	002320	海峡股份	14,925	90,147.00	0.03
479	000582	北部湾港	11,800	89,680.00	0.03
480	000062	深圳华强	7,512	85,787.04	0.03
481	001213	中铁特货	19,000	83,790.00	0.03
482	301095	广立微	1,000	82,650.00	0.03
483	301308	江波龙	800	81,408.00	0.03
484	000869	张裕 A	2,600	79,716.00	0.03
485	300894	火星人	3,100	79,174.00	0.03
486	300821	东岳硅材	8,000	77,920.00	0.03
487	301238	瑞泰新材	3,800	77,292.00	0.03
488	002461	珠江啤酒	8,700	76,647.00	0.03
489	002399	海普瑞	6,520	74,784.40	0.03
490	000553	安道麦 A	8,600	72,584.00	0.03
491	001289	龙源电力	3,200	72,000.00	0.03
492	300741	华宝股份	2,800	59,976.00	0.02
493	301207	华兰疫苗	1,700	56,542.00	0.02
494	002978	安宁股份	1,700	54,587.00	0.02
495	001308	康冠科技	1,760	48,329.60	0.02
496	003039	顺控发展	2,800	47,488.00	0.02
497	301200	大族数控	1,000	39,880.00	0.01
498	001322	箭牌家居	2,300	38,502.00	0.01
499	301177	迪阿股份	1,000	38,430.00	0.01
500	002901	大博医疗	1,200	37,296.00	0.01

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

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	000540	*ST 中天	100,100	14,014.00	0.01

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	300750	宁德时代	803,924.00	0.33
2	002517	恺英网络	738,313.25	0.30
3	300212	易华录	370,100.00	0.15
4	002015	协鑫能科	286,135.00	0.12
5	301269	华大九天	257,573.00	0.10
6	002317	众生药业	255,088.00	0.10
7	002326	永太科技	216,983.00	0.09
8	002607	中公教育	213,723.00	0.09
9	000422	湖北宜化	210,493.00	0.09
10	300910	瑞丰新材	197,425.00	0.08
11	301236	软通动力	182,143.00	0.07
12	001227	兰州银行	160,692.00	0.07
13	300919	中伟股份	140,505.00	0.06
14	300751	迈为股份	126,400.00	0.05
15	002555	三七互娱	125,430.00	0.05
16	301268	铭利达	124,876.00	0.05
17	300760	迈瑞医疗	123,708.00	0.05
18	300769	德方纳米	120,314.00	0.05
19	002156	通富微电	116,961.00	0.05
20	300459	汤姆猫	109,597.00	0.04

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	002013	中航机电	456,122.32	0.19
2	002648	卫星化学	195,984.00	0.08
3	000166	申万宏源	189,192.00	0.08
4	300671	富满微	184,722.00	0.08
5	002839	张家港行	173,299.00	0.07
6	000568	泸州老窖	166,620.00	0.07
7	000858	五粮液	164,171.00	0.07

8	002002	鸿达兴业	149,737.40	0.06
9	000333	美的集团	146,198.00	0.06
10	300072	海新能科	136,397.80	0.06
11	002415	海康威视	134,771.00	0.05
12	002390	信邦制药	129,059.50	0.05
13	002594	比亚迪	128,700.00	0.05
14	000685	中山公用	123,425.80	0.05
15	000656	金科股份	121,975.00	0.05
16	300059	东方财富	114,578.00	0.05
17	000651	格力电器	109,236.00	0.04
18	000596	古井贡酒	106,609.00	0.04
19	002157	*ST 正邦	97,536.00	0.04
20	300760	迈瑞医疗	95,439.00	0.04

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	9,666,617.83
卖出股票收入（成交）总额	8,505,504.32

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	36,603.05	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	36,603.05	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127086	恒邦转债	366	36,603.05	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

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	418.74
2	应收清算款	10,985.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,404.17

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000540	*ST 中天	14,014.00	0.01	退市

§ 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		南方深证成份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
5,208	40,544.26	14,284,991.00	6.77%	79,043,042.00	37.43%	117,826,474.00	55.80%

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	广发证券股份有限公司	3,338,928.00	1.58%
2	海通证券股份有限公司	3,091,730.00	1.46%
3	章斌	2,526,375.00	1.20%
4	深圳前海信诚中富基金管理有限公司-信诚檀青 10 号私募证券投资基金	1,653,300.00	0.78%
5	深圳前海信诚中富基金管理有限公司-信诚檀青 8 号私募证券投资基金	1,629,900.00	0.77%
6	中信证券股份有限公司	991,895.00	0.47%
7	郝世军	911,711.00	0.43%
8	浙江华浙白马房地产开发有限公司	910,052.00	0.43%
9	华泰证券股份有限公司	873,424.00	0.41%
10	吴飞	737,889.00	0.35%
11	中国工商银行股份有限公司-南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	117,826,474.00	55.80%

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(2009 年 12 月 4 日)基金份额总额	4,127,538,537.00
本报告期期初基金份额总额	190,154,507.00
本报告期基金总申购份额	39,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	18,000,000.00
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	211,154,507.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	2	18,121,032.57	100.00%	1,812.21	100.00%	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

东北证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	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	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		交总额的 比例		额的比例
申万宏源	115,084.02	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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	南方基金关于旗下部分基金增加中金财富为申购赎回代理券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-15
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可转换公司债券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
3	南方基金关于旗下部分基金增加东海证券为申购赎回代理券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-27
4	南方基金关于旗下部分基金增加华宝证券为申购赎回代理券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-11
5	南方基金关于旗下部分基金增加国金证券为申购赎回代理券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-31
6	南方基金关于旗下部分基金增加华福证券为申购赎回代理券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-01
7	关于南方基金管理股份有限公司旗下基金调整	上海证券报、基金管	2023-06-10

	股票估值方法的提示性公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
--	--------------	--------------------	--

§ 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	112,765,374.00	6,000,000.00	938,900.00	117,826,474.00	55.80%
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深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《深证成份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、《深证成份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>