

# 上证 380 交易型开放式指数证券投资 基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 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。

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 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。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告.....	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 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.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
8.6	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.....	62
8.7	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.....	62
8.8	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.....	62
8.9	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.....	62
8.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	62
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
8.12	投资组合报告附注.....	63
§9	基金份额持有人信息.....	64
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
9.2	期末上市基金前十名持有人.....	64
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
9.4	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.....	65
§10	开放式基金份额变动.....	65
§11	重大事件揭示.....	65
11.1	基金份额持有人大会决议.....	65
11.2	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.....	65
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
11.4	基金投资策略的改变.....	66
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	66
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
11.8	其他重大事件.....	68
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	69
12.1	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.....	70
12.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§13	备查文件目录.....	70
13.1	备查文件目录.....	70
13.2	存放地点.....	70
13.3	查阅方式.....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方上证 380ETF
场内简称	380ETF；上证 380ETF
基金主代码	510290
交易代码	510290
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 16 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	92,448,915.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 11 月 8 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，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。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。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。
业绩比较基准	上证 380 指数，简称 380 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	中国建设银行股份有限公司

	姓名	常克川	王小飞
信息披露负责人	联系电话	0755-82763888	021-60637103
	电子邮箱	manager@southernfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	021-60637228
传真		0755-82763889	021-60635778
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼		北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼		北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518017		100033
法定代表人	周易		田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	540,231.13	3,164,625.15	30,213,821.82
本期利润	-7,952,185.61	-28,350,649.74	30,019,816.53
加权平均基金份额本期利润	-0.0952	-0.3478	0.4228
本期加权平均净值利润率	-4.79%	-17.03%	20.30%
本期基金份额净值增长率	-5.22%	-15.96%	23.43%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	78,837,796.36	80,636,584.66	71,014,350.86
期末可供分配基金份额利润	0.8527	0.9548	1.0374
期末基金资产净值	171,286,711.36	165,085,499.66	159,224,905.56
期末基金份额净值	1.8528	1.9549	2.3262
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	85.28%	95.49%	132.62%

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。

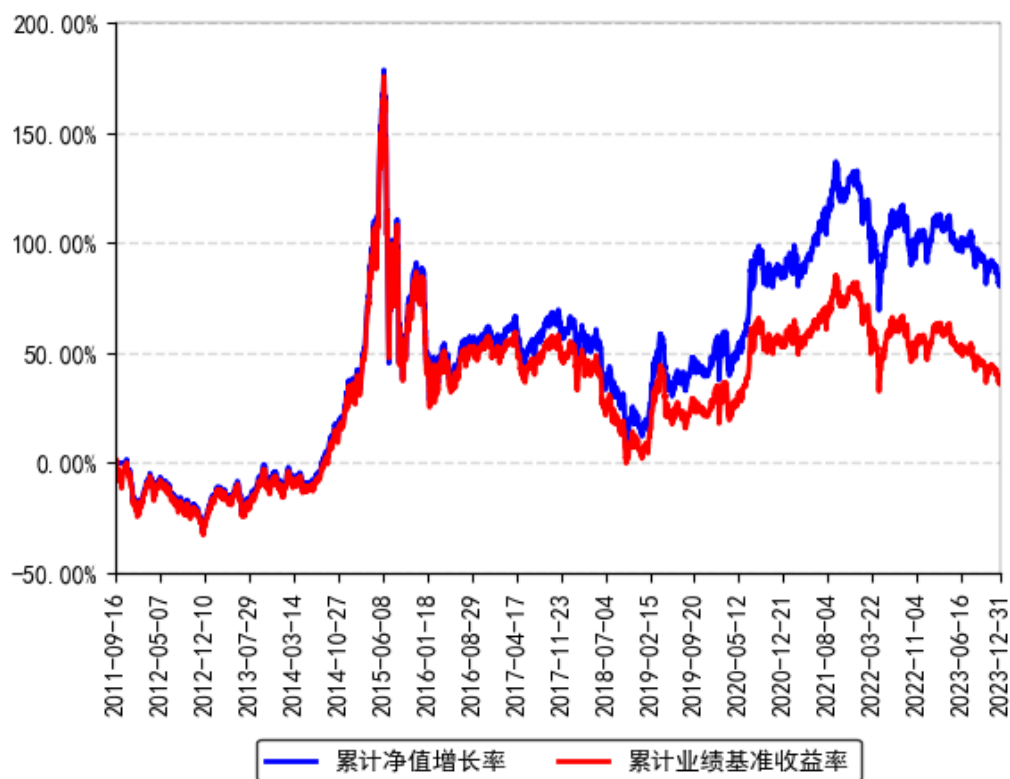
#### 3.2 基金净值表现

##### 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
过去三个月	-4.61%	0.76%	-4.54%	0.76%	-0.07%	0.00%
过去六个月	-7.53%	0.75%	-7.91%	0.75%	0.38%	0.00%
过去一年	-5.22%	0.73%	-7.09%	0.73%	1.87%	0.00%
过去三年	-1.69%	1.03%	-10.74%	1.03%	9.05%	0.00%
过去五年	62.61%	1.18%	34.55%	1.19%	28.06%	-0.01%
自基金合同生效起至今	85.28%	1.53%	39.51%	1.53%	45.77%	0.00%

### 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

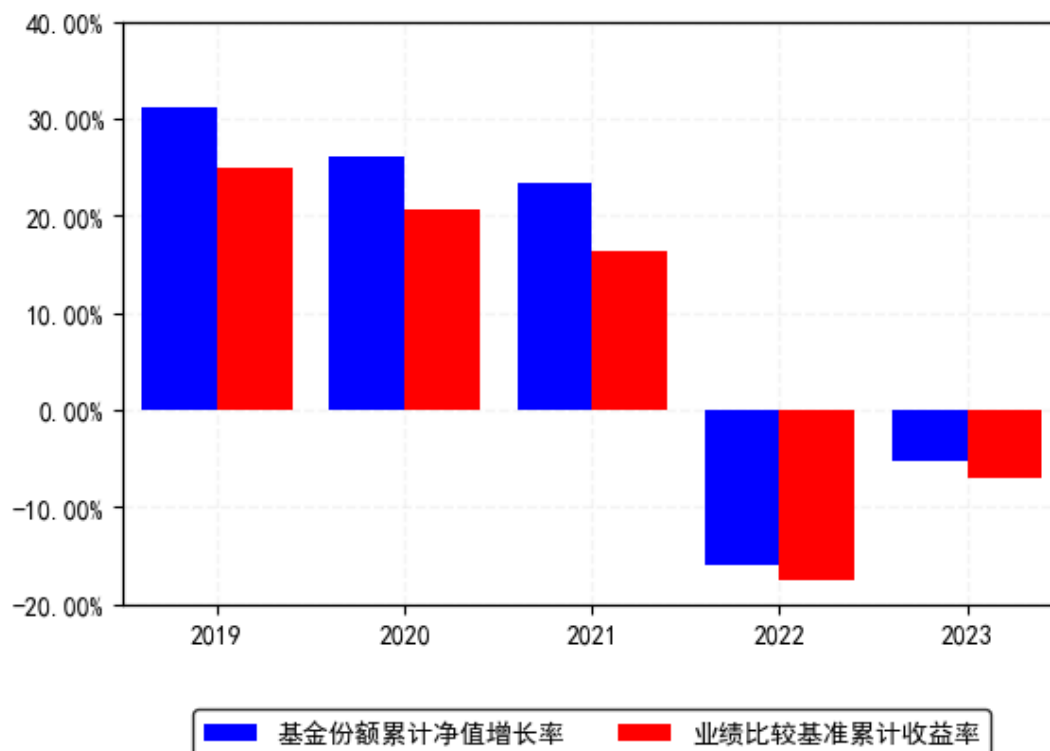
南方上证380ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



南方上证380ETF每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙伟	本基金基金经理	2019 年 7 月 12 日	-	13 年	<p>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；2023 年 7 月 25 日至今，任南方上海金 ETF 发起联接基金经理。</p>

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 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由工资、奖金等构成。工资由基金经理任职的职位职级决定，重点体现员工能力和职位价值导向原则；奖金由员工的绩效贡献决定，重点体现绩效导向与差异化原则。对于兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理，公司对私募资产管理计划产生的超额业绩报酬实施对应激励，并依据其管理产品的长期业绩与个人综合贡献情况实施分配。为贯彻激励约束相结合、激励与约束并重的管理理念，鼓励长期任职，防范经营风险，公司对基金经理奖金实施递延发放；同时，为加强员工利益与持有人利益相捆绑及一致性，公司对基金经理实施了跟投购基机制，有效引导基金经理为客户持续创造价值。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立和完善了兼任相关的制度及流程，确保兼任基金经理公平对待其管理的所有投资组合。通过对基金经理的投资交易行为进行监控和分析，本报告期内，两两组合间各项操作、流程及事后分析均正常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 4.3.3 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 25 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

本报告期内上证 380 指数下跌 7.09%。

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）新股上市初期涨幅较大的影响；
- （2）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；
- （3）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；
- （4）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。

#### 4.4.2 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 1.8528 元，报告期内，份额净值增长率为-5.22%，同期业绩基准增长率为-7.09%。

#### 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，国内经济 N 型筑底，实现温和复苏，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明显。

2024 年，在开年快速回调后，后市展望更加乐观，主要基于以下判断：1、国内经济将延续复苏态势，上市公司盈利有望转好；2、预期货币将继续宽松，财政政策有望更加积极；3、企业和居民资产负债表有望改善，增量资金有入场迹象；4、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，力求实现对业绩基准的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身情况和投资目标，借助投资本基金参与市场。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况，严格遵守包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求，有效落实了 2023 年度发布的《重要货币市场基金监管暂行规定》《基金从业人员管理规则》和《证券期货经营机构投资管理人员注册登记规则》等公募基金相关新法律法规。

本基金管理人坚持从保护基金份额持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础、合规为先、行稳致远”的合规理念。严守底线，始终把内控和合规管理作为规范化管理的重点，通过有效过程管控，将合规管理全面深度嵌入流程与业务，积极推动主动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，制订和修订了包括《合规手册》《数据合规管理规定》《从业人员个人投资管理办法》《防控内幕信息及交易管理制度》《信息和保密管理制度》《离任审计及审查制度》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在进一步优化制度体系的基础上，本基金管理人贯彻“合规为先，行稳致远”的合规理念，着力创新文化宣传方式，提升宣导效果；优化员工行为检查方式，加强员工行为规范检查力度，严格进行合规问责，强化全员合规、主动合规理念；对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展了定期稽核、专项稽核及多项自查，通过专项稽核和

合规检查工作识别问题、防范风险、推动解决，促进公司业务合规运作、稳健经营；根据监管形势和市场形势的变化并结合业务发展的实际情况、各类组合或者业务特点，完善投资合规管理机制，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障新产品、新业务合规开展；积极开展合规审核工作，不断强化销售合规风险管控，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；开展各类监管组织的投教活动，提升投教质效；监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱相关工作，贯彻风险为本，自评估驱动，反洗钱重点问题解决方案实现落地推进。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程，有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全全部管理制度，不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性，持续全面推进合规数字化工作在更广范围应用并与合规管理工作深度融合，努力防范和管理各类风险，切实维护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 23064 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人

<p>审计意见</p>	<p>(一) 我们审计的内容 我们审计了上证 380 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南方上证 380ETF 基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了南方上证 380ETF 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于南方上证 380ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>-</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>南方上证 380ETF 基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估南方上证 380ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算南方上证 380ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南方上证 380ETF 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇</p>



	<p>总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对南方上证 380ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致南方上证 380ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张振波   吴玲玮
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31	上年度末 2022 年 12 月
----	-----	--------------------	------------------

		日	31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	706,795.65	916,187.35
结算备付金		489,397.72	494,133.96
存出保证金		130,858.70	165,461.71
交易性金融资产	7.4.7.2	170,268,724.60	163,783,602.37
其中：股票投资		170,223,721.64	163,783,602.37
基金投资		-	-
债券投资		45,002.96	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		-	650.21
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		171,595,776.67	165,360,035.60
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		35,316.95	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		69,688.05	70,460.18
应付托管费		13,937.64	14,092.02
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.10	0.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	190,122.57	189,983.57

负债合计		309,065.31	274,535.94
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	92,448,915.00	84,448,915.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	78,837,796.36	80,636,584.66
净资产合计		171,286,711.36	165,085,499.66
负债和净资产总计		171,595,776.67	165,360,035.60

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.8528 元，基金份额总额 92,448,915.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：上证 380 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-6,666,297.00	-27,066,337.38
1.利息收入		13,604.37	10,575.48
其中：存款利息收入	7.4.7.9	13,604.37	10,575.48
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,811,305.64	4,433,275.53
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,837,410.67	645,547.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	112,707.35	258,047.42
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-113,245.32	-143,674.22
股利收益	7.4.7.14	3,649,254.28	3,673,354.95
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	7.4.7.15	-8,492,416.74	-31,515,274.89

失以“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	1,209.73	5,086.50
减:二、营业总支出		1,285,888.61	1,284,312.36
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	829,313.42	828,030.96
其中:暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	165,862.65	165,606.09
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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		37.54	0.31
8.其他费用	7.4.7.17	290,675.00	290,675.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-7,952,185.61	-28,350,649.74
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-7,952,185.61	-28,350,649.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-7,952,185.61	-28,350,649.74

### 7.3 净资产变动表

会计主体:上证 380 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 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	84,448,915.00	-	80,636,584.66	165,085,499.66
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	84,448,915.00	-	80,636,584.66	165,085,499.66
三、本期增减变	8,000,000.00	-	-1,798,788.30	6,201,211.70

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	-7,952,185.61	-7,952,185.61
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	8,000,000.00	-	6,153,397.31	14,153,397.31
其中：1.基金申购款	14,000,000.00	-	12,266,826.00	26,266,826.00
2.基金赎回款	-6,000,000.00	-	-6,113,428.69	-12,113,428.69
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	92,448,915.00	-	78,837,796.36	171,286,711.36
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	68,448,915.00	-	90,775,990.56	159,224,905.56
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	68,448,915.00	-	90,775,990.56	159,224,905.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	16,000,000.00	-	-10,139,405.90	5,860,594.10
（一）、综合收益总额	-	-	-28,350,649.74	-28,350,649.74
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	16,000,000.00	-	18,211,243.84	34,211,243.84

“-”号填列)				
其中: 1.基金申购款	32,000,000.00	-	35,958,893.42	67,958,893.42
2.基金赎回款	-16,000,000.00	-	-17,747,649.58	-33,747,649.58
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	84,448,915.00	-	80,636,584.66	165,085,499.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_ 杨小松 \_\_\_\_\_ 常克川 \_\_\_\_\_ 徐超 \_\_\_\_\_  
 基金管理人负责人      主管会计工作负责人      会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

上证 380 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1096 号《关于核准上证 380 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司,已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 330,429,892.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 381 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 330,448,915.00 份基金份额,其中通过直销机构网下现金认购部分的认购资金利息折合 19,023.00 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数上证 380 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;在正常市场情况下,力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超

过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金主要投资于标的指数的成份股和备选成份股；本基金也可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票以及存托凭证）、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为上证 380 指数。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF，于 2011 年 9 月 20 日募集成立了上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“上证 380ETF 联接基金”）。上证 380ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2024 年 3 月 28 日批准报出。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性



金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》, 自 2023 年 8 月 28 日起, 证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	706,795.65	916,187.35
等于: 本金	706,723.29	916,106.23
加: 应计利息	72.36	81.12
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	706,795.65	916,187.35

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	191,566,961.14	-	170,223,721.64	-21,343,239.50	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	45,000.00	2.96	45,002.96	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	45,000.00	2.96	45,002.96	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	191,611,961.14	2.96	170,268,724.60	-21,343,239.50
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	176,572,025.13	-	163,783,602.37	-12,788,422.76
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	176,572,025.13	-	163,783,602.37	-12,788,422.76

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 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 12 月 31 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	1,076,600.00	-	-	-
一指期货	1,076,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,076,600.00	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 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	1,230,960.00	-	-	-
一指期货	1,230,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,230,960.00	-	-	-

##### 7.4.7.3.2 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
IC2403	IC2403	1.00	1,082,920.00	6,320.00
合计				6,320.00

减：可抵销期货暂收款	6,320.00
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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 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	5,122.57	4,983.57
其中：交易所市场	5,122.57	4,983.57
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应退退补款	-	-
预提费用	150,000.00	150,000.00
应付指数使用费	35,000.00	35,000.00
可退替代款	-	-
合计	190,122.57	189,983.57

#### 7.4.7.7 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	84,448,915.00	84,448,915.00
本期申购	14,000,000.00	14,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-6,000,000.00	-6,000,000.00
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	92,448,915.00	92,448,915.00

注：红利再投及转入份额计入本期申购，转出份额计入本期赎回。

#### 7.4.7.8 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	91,100,219.66	-10,463,635.00	80,636,584.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	91,100,219.66	-10,463,635.00	80,636,584.66
本期利润	540,231.13	-8,492,416.74	-7,952,185.61
本期基金份额交易产生的变动数	9,017,001.24	-2,863,603.93	6,153,397.31
其中：基金申购款	15,577,288.52	-3,310,462.52	12,266,826.00
基金赎回款	-6,560,287.28	446,858.59	-6,113,428.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	100,657,452.03	-21,819,655.67	78,837,796.36

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,723.47	2,726.17
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	10,866.92	7,827.63
其他	13.98	21.68
合计	13,604.37	10,575.48

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,323,615.82	35,873.97
股票投资收益——赎回差价收入	-513,794.85	609,673.41
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	-1,837,410.67	645,547.38

#### 7.4.7.10.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	47,426,017.19	56,623,763.52
减：卖出股票成本总额	48,698,355.28	56,504,055.30
减：交易费用	51,277.73	83,834.25
买卖股票差价收入	-1,323,615.82	35,873.97

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

#### 7.4.7.10.3 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	12,113,428.69	33,747,649.58
减：现金支付赎回款总额	-8,718.31	-11,563.42
减：赎回股票成本总额	12,635,941.85	33,149,539.59
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-513,794.85	609,673.41

#### 7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

#### 7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	78.88	177.29
债券投资收益——买卖债券（、 债转股及债券到期兑付）差价收入	112,628.47	257,870.13
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	112,707.35	258,047.42

#### 7.4.7.11.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	543,710.49	1,426,086.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	431,000.00	1,168,000.00
减：应计利息总额	77.80	182.63
减：交易费用	4.22	33.60
买卖债券差价收入	112,628.47	257,870.13

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

#### 7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.11.5 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.12 贵金属投资收益

##### 7.4.7.12.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.12.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.12.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

##### 7.4.7.12.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

##### 7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

#### 7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	-113,245.32	-143,674.22

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,649,254.28	3,673,354.95
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	3,649,254.28	3,673,354.95

#### 7.4.7.15 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-8,554,816.74	-31,437,074.89
——股票投资	-8,554,816.74	-31,437,074.89
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	62,400.00	-78,200.00
——权证投资	-	-
——期货投资	62,400.00	-78,200.00
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	-8,492,416.74	-31,515,274.89

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	1,209.73	5,086.50
合计	1,209.73	5,086.50

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

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	140,000.00	140,000.00
银行费用	675.00	675.00
合计	290,675.00	290,675.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	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
南方资本管理有限公司("南方资本")	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司("南方东英")	基金管理人的子公司
厦门国际信托有限公司("厦门国际信托")	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司("深圳投资控股")	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金("南方上证 380ETF 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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	1,214,225.00	1.25%	114,804,146.45	100.00%

#### 7.4.10.1.2 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	105,428.45	19.39%	1,424,971.36	99.92%

#### 7.4.10.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	121.38	1.24%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	11,480.70	100.00%	4,983.61	100.00%

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。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
----	-------------------------------------	--

当期发生的基金应支付的管理费	829,313.42	828,030.96
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	829,313.42	828,030.96

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

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	165,862.65	165,606.09

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

#### 7.4.10.5.2 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 12 月 31 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	385,800.00	0.42%	440,300.00	0.52%
南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	78,513,441.00	84.93%	73,036,841.00	86.49%

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

#### 7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	706,795.65	2,723.47	916,187.35	2,726.17

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

#### 7.4.10.7 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 12 月 31 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	113066	平煤转债	配债	750	75,000.00
华泰联合	110095	双良转债	配债	680	68,000.00
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	113666	爱玛转债	配债	260	26,000.00
华泰联合	113674	华设转债	配债	170	17,000.00
兴业证券	113670	金 23 转债	配债	130	13,000.00
兴业证券,华泰联合	601916	浙商银行	配股	125,700	253,914.00

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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



				股/张)	
华泰联合	113062	常银转债	配债	2,610	261,000.00
华泰联合	113055	成银转债	配债	2,300	230,000.00
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	5,112	115,173.36
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	1,240	100,192.00
华泰联合	113650	博 22 转债	配债	180	18,000.00
华泰联合	113659	莱克转债	配债	110	11,000.00
兴业证券	113653	永 22 转债	配债	170	17,000.00
兴业证券	603280	南方路机	网下申购	363	8,621.25

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 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。

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.2 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
113069	博 23 转债	2023 年 12 月 25 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.01	450	45,000.00	45,002.96	-

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

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

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

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

4. 基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪上证 380 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，跟踪上证 380 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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占净资产的比例为 0.03%（上期末：本基金无债券投资）。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的

流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合该要求。

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

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	706,795.65	-	-	-	706,795.65

结算备付金	489,397.72	-	-	-	489,397.72
存出保证金	908.30	-	-	129,950.40	130,858.70
交易性金融资产	-	45,002.96	-	170,223,721.64	170,268,724.60
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	1,197,101.67	45,002.96	-	170,353,672.04	171,595,776.67
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	-	-	-	35,316.95	35,316.95
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	69,688.05	69,688.05
应付托管费	-	-	-	13,937.64	13,937.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.10	0.10
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	190,122.57	190,122.57

负债总计	-	-	-	309,065.31	309,065.31
利率敏感度缺口	1,197,101.67	45,002.96	-	170,044,606.73	171,286,711.36
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					
货币资金	916,187.35	-	-	-	916,187.35
结算备付金	494,133.96	-	-	-	494,133.96
存出保证金	978.51	-	-	164,483.20	165,461.71
交易性金融资产	-	-	-	163,783,602.37	163,783,602.37
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	-	-	-	650.21	650.21
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,411,299.82	-	-	163,948,735.78	165,360,035.60
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	-	-	-	70,460.18	70,460.18
应付托管费	-	-	-	14,092.02	14,092.02
应付销售服	-	-	-	-	-

务费					
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.17	0.17
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	189,983.57	189,983.57
负债总计	-	-	-	274,535.94	274,535.94
利率敏感度缺口	1,411,299.82	-	-	163,674,199.84	165,085,499.66

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 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	

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

不适用。

#### 7.4.13.4.3 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，跟踪上证 380 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，上证 380 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基

金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	170,223,721.64	99.38	163,783,602.37	99.21
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	170,223,721.64	99.38	163,783,602.37	99.21

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。

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	8,521,700.77	8,223,786.12
	2.组合自身基准下降 5%	-8,521,700.77	-8,223,786.12

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	170,223,721.64	163,711,214.11
第二层次	45,002.96	72,388.26
第三层次	-	-
合计	170,268,724.60	163,783,602.37

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票	

期初余额	-	316,443.86	316,443.86
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	251,905.46	251,905.46
当期利得或损失总额	-	-64,538.40	-64,538.40
其中：计入损益的利得或损失	-	-64,538.40	-64,538.40
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：本基金持有的第三层次的交易性金融资产包含证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。本基金从第三层次转出的交易性金融资产包含限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上期末：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	170,223,721.64	99.20
	其中：股票	170,223,721.64	99.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,002.96	0.03

	其中：债券	45,002.96	0.03
	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	1,196,193.37	0.70
8	其他资产	130,858.70	0.08
9	合计	171,595,776.67	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。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	391,419.00	0.23
B	采矿业	10,906,890.31	6.37
C	制造业	89,518,972.38	52.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,835,581.58	5.16
E	建筑业	4,021,211.65	2.35
F	批发和零售业	6,102,405.62	3.56
G	交通运输、仓储和邮政业	8,474,014.09	4.95
H	住宿和餐饮业	482,158.16	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,216,949.79	7.13
J	金融业	19,748,780.57	11.53
K	房地产业	3,306,812.16	1.93
L	租赁和商务服务业	1,023,787.48	0.60
M	科学研究和技术服务业	1,826,172.96	1.07
N	水利、环境和公共设施管理业	1,256,899.53	0.73
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	1,501,869.00	0.88
S	综合	609,797.36	0.36
	合计	170,223,721.64	99.38

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 8.2.3 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。

### 8.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	601229	上海银行	457,500	2,731,275.00	1.59
2	601006	大秦铁路	282,900	2,039,709.00	1.19
3	600886	国投电力	137,200	1,808,296.00	1.06
4	601916	浙商银行	693,800	1,748,376.00	1.02
5	600015	华夏银行	292,900	1,646,098.00	0.96
6	600926	杭州银行	163,700	1,638,637.00	0.96
7	600845	宝信软件	33,149	1,617,671.20	0.94
8	600674	川投能源	102,600	1,551,312.00	0.91
9	601901	方正证券	189,400	1,526,564.00	0.89
10	600256	广汇能源	211,400	1,509,396.00	0.88
11	601058	赛轮轮胎	114,840	1,349,370.00	0.79
12	600079	人福医药	52,600	1,307,636.00	0.76
13	601825	沪农商行	221,800	1,273,132.00	0.74
14	601168	西部矿业	87,700	1,251,479.00	0.73
15	601699	潞安环能	55,000	1,205,050.00	0.70
16	600741	华域汽车	72,500	1,180,300.00	0.69
17	600372	中航机载	89,000	1,173,020.00	0.68
18	600161	天坛生物	37,900	1,172,626.00	0.68
19	601077	渝农商行	284,800	1,161,984.00	0.68
20	688777	中控技术	25,295	1,147,128.25	0.67
21	600109	国金证券	119,900	1,088,692.00	0.64
22	600885	宏发股份	38,326	1,059,330.64	0.62
23	688169	石头科技	3,598	1,018,054.10	0.59
24	600536	中国软件	27,702	1,004,474.52	0.59
25	600183	生益科技	54,100	990,571.00	0.58
26	601838	成都银行	87,700	987,502.00	0.58
27	688072	拓荆科技	4,213	974,466.90	0.57
28	600233	圆通速递	79,200	973,368.00	0.57
29	688099	晶晨股份	15,247	954,919.61	0.56
30	600873	梅花生物	94,800	905,340.00	0.53
31	601799	星宇股份	6,600	865,326.00	0.51

32	688617	惠泰医疗	2,215	860,527.50	0.50
33	600862	中航高科	38,500	852,775.00	0.50
34	600177	雅戈尔	127,800	837,090.00	0.49
35	600129	太极集团	17,900	831,634.00	0.49
36	601898	中煤能源	84,200	815,898.00	0.48
37	600348	华阳股份	83,000	810,080.00	0.47
38	601128	常熟银行	126,119	805,900.41	0.47
39	688120	华海清科	4,292	805,608.40	0.47
40	600546	山煤国际	45,600	798,456.00	0.47
41	600061	国投资本	118,200	796,668.00	0.47
42	603179	新泉股份	15,700	796,147.00	0.46
43	603816	顾家家居	22,666	793,310.00	0.46
44	600529	山东药玻	30,480	780,288.00	0.46
45	600985	淮北矿业	45,700	759,991.00	0.44
46	600559	老白干酒	33,659	759,010.45	0.44
47	601577	长沙银行	111,000	757,020.00	0.44
48	600499	科达制造	71,700	756,435.00	0.44
49	688301	奕瑞科技	2,300	748,098.00	0.44
50	601666	平煤股份	63,911	738,811.16	0.43
51	601198	东兴证券	89,200	734,116.00	0.43
52	688017	绿的谐波	4,756	730,046.00	0.43
53	603198	迎驾贡酒	11,000	729,190.00	0.43
54	688002	睿创微纳	16,412	725,738.64	0.42
55	600803	新奥股份	42,750	719,055.00	0.42
56	603000	人民网	25,400	710,692.00	0.41
57	600884	杉杉股份	52,000	708,240.00	0.41
58	600486	扬农化工	11,177	705,492.24	0.41
59	600879	航天电子	91,100	702,381.00	0.41
60	601865	福莱特	26,200	699,540.00	0.41
61	601997	贵阳银行	134,500	691,330.00	0.40
62	605499	东鹏饮料	3,700	675,287.00	0.39
63	600549	厦门钨业	39,100	671,738.00	0.39
64	603077	和邦生物	284,400	671,184.00	0.39
65	603712	七一二	21,300	671,163.00	0.39
66	600170	上海建工	286,100	669,474.00	0.39
67	688188	柏楚电子	2,634	666,691.74	0.39
68	601567	三星医疗	32,483	665,901.50	0.39
69	600153	建发股份	69,100	665,433.00	0.39
70	603005	晶方科技	29,980	658,360.80	0.38
71	600392	盛和资源	64,460	656,202.80	0.38
72	600141	兴发集团	35,800	653,350.00	0.38
73	603899	晨光股份	17,042	639,927.10	0.37
74	601018	宁波港	179,000	637,240.00	0.37

75	600704	物产中大	143,300	634,819.00	0.37
76	600998	九州通	89,960	630,619.60	0.37
77	600018	上港集团	128,500	629,650.00	0.37
78	603979	金诚信	16,600	626,816.00	0.37
79	601717	郑煤机	49,500	626,175.00	0.37
80	603658	安图生物	10,800	615,708.00	0.36
81	600673	东阳光	83,192	609,797.36	0.36
82	688333	铂力特	5,231	606,272.90	0.35
83	600583	海油工程	101,700	604,098.00	0.35
84	600236	桂冠电力	108,750	602,475.00	0.35
85	600039	四川路桥	80,180	600,548.20	0.35
86	603456	九洲药业	24,800	600,408.00	0.35
87	603338	浙江鼎力	11,678	597,563.26	0.35
88	601456	国联证券	55,000	596,200.00	0.35
89	603195	公牛集团	6,200	593,030.00	0.35
90	600863	内蒙华电	150,100	585,390.00	0.34
91	600820	隧道股份	101,200	582,912.00	0.34
92	601216	君正集团	155,300	580,822.00	0.34
93	688050	爱博医疗	3,373	580,290.92	0.34
94	688037	芯源微	4,343	580,268.23	0.34
95	600563	法拉电子	6,227	576,620.20	0.34
96	600363	联创光电	16,800	571,200.00	0.33
97	600435	北方导航	48,200	565,868.00	0.33
98	600655	豫园股份	89,600	556,416.00	0.32
99	688639	华恒生物	4,393	553,078.70	0.32
100	600325	华发股份	76,000	547,960.00	0.32
101	600008	首创环保	202,640	545,101.60	0.32
102	600498	烽火通信	32,700	544,128.00	0.32
103	688032	禾迈股份	1,994	538,380.00	0.31
104	601016	节能风电	178,700	536,100.00	0.31
105	600566	济川药业	17,000	534,310.00	0.31
106	688005	容百科技	13,414	533,877.20	0.31
107	600380	健康元	42,886	533,072.98	0.31
108	688536	思瑞浦	3,619	529,459.70	0.31
109	600282	南钢股份	141,800	524,660.00	0.31
110	603233	大参林	21,003	522,974.70	0.31
111	600641	万业企业	29,940	516,764.40	0.30
112	603613	国联股份	23,276	512,304.76	0.30
113	600422	昆药集团	24,452	510,068.72	0.30
114	688019	安集科技	3,187	509,155.12	0.30
115	603728	鸣志电器	7,720	508,362.00	0.30
116	601636	旗滨集团	74,100	506,844.00	0.30
117	601880	辽港股份	346,500	502,425.00	0.29

118	603225	新凤鸣	35,172	499,442.40	0.29
119	601677	明泰铝业	43,900	497,826.00	0.29
120	600580	卧龙电驱	42,182	494,794.86	0.29
121	603927	中科软	16,420	492,271.60	0.29
122	603444	吉比特	2,000	490,240.00	0.29
123	603893	瑞芯微	7,700	488,180.00	0.29
124	688556	高测股份	12,384	482,852.16	0.28
125	600258	首旅酒店	30,868	482,158.16	0.28
126	688166	博瑞医药	13,637	477,295.00	0.28
127	601000	唐山港	136,332	477,162.00	0.28
128	600667	太极实业	67,795	476,598.85	0.28
129	688516	奥特维	5,259	475,939.50	0.28
130	601001	晋控煤业	38,500	474,705.00	0.28
131	688385	复旦微电	12,164	469,895.32	0.27
132	603737	三棵树	9,742	463,816.62	0.27
133	601231	环旭电子	30,526	461,247.86	0.27
134	603300	华铁应急	72,000	460,800.00	0.27
135	688200	华峰测控	3,748	460,254.40	0.27
136	603236	移远通信	8,539	458,971.25	0.27
137	688116	天奈科技	15,803	458,919.12	0.27
138	688598	金博股份	6,493	453,860.70	0.26
139	600970	中材国际	48,580	453,737.20	0.26
140	600123	兰花科创	40,980	452,419.20	0.26
141	600848	上海临港	44,100	443,205.00	0.26
142	600329	达仁堂	13,095	440,646.75	0.26
143	600481	双良节能	51,600	436,536.00	0.25
144	603129	春风动力	4,200	429,408.00	0.25
145	603298	杭叉集团	17,200	427,936.00	0.25
146	600755	厦门国贸	60,788	423,692.36	0.25
147	601222	林洋能源	66,300	423,657.00	0.25
148	600131	国网信通	27,700	419,655.00	0.25
149	600316	洪都航空	19,800	419,166.00	0.24
150	605111	新洁能	10,980	415,373.40	0.24
151	600582	天地科技	76,160	414,310.40	0.24
152	603127	昭衍新药	17,426	413,170.46	0.24
153	601665	齐鲁银行	105,400	412,114.00	0.24
154	600850	电科数字	18,942	411,988.50	0.24
155	600373	中文传媒	31,200	411,216.00	0.24
156	688082	盛美上海	3,922	409,496.02	0.24
157	600338	西藏珠峰	33,620	408,819.20	0.24
158	601965	中国汽研	18,500	408,110.00	0.24
159	600737	中粮糖业	49,200	405,408.00	0.24
160	688066	航天宏图	9,538	402,885.12	0.24

161	600612	老凤祥	5,833	402,477.00	0.23
162	605090	九丰能源	14,400	402,192.00	0.23
163	603883	老百姓	13,448	401,960.72	0.23
164	600452	涪陵电力	30,262	399,458.40	0.23
165	603283	赛腾股份	5,500	399,080.00	0.23
166	600116	三峡水利	52,800	397,584.00	0.23
167	600596	新安股份	43,469	396,437.28	0.23
168	600598	北大荒	32,700	391,419.00	0.23
169	600323	瀚蓝环境	22,477	389,526.41	0.23
170	688278	特宝生物	7,408	387,808.80	0.23
171	600273	嘉化能源	45,100	387,409.00	0.23
172	600483	福能股份	46,710	386,291.70	0.23
173	600633	浙数文化	34,900	385,994.00	0.23
174	601611	中国核建	55,600	385,308.00	0.22
175	600801	华新水泥	30,900	384,087.00	0.22
176	600378	昊华科技	12,600	384,048.00	0.22
177	603197	保隆科技	6,800	383,520.00	0.22
178	603027	千禾味业	23,595	381,531.15	0.22
179	600916	中国黄金	38,600	380,982.00	0.22
180	601598	中国外运	72,500	379,900.00	0.22
181	603108	润达医疗	18,660	379,731.00	0.22
182	603505	金石资源	13,925	378,063.75	0.22
183	688016	心脉医疗	1,937	376,998.31	0.22
184	603568	伟明环保	23,552	376,832.00	0.22
185	603267	鸿远电子	7,440	373,488.00	0.22
186	603083	剑桥科技	9,900	373,428.00	0.22
187	600171	上海贝岭	26,220	372,848.40	0.22
188	603588	高能环境	56,528	369,693.12	0.22
189	601992	金隅集团	191,800	366,338.00	0.21
190	603650	彤程新材	11,000	366,300.00	0.21
191	600395	盘江股份	59,300	365,881.00	0.21
192	603599	广信股份	25,076	363,602.00	0.21
193	600110	诺德股份	64,289	362,589.96	0.21
194	600750	江中药业	17,346	362,184.48	0.21
195	600933	爱柯迪	16,500	362,010.00	0.21
196	688139	海尔生物	8,817	357,264.84	0.21
197	600285	羚锐制药	20,877	357,205.47	0.21
198	603393	新天然气	11,684	357,179.88	0.21
199	688596	正帆科技	8,988	356,194.44	0.21
200	603279	景津装备	15,920	351,991.20	0.21
201	600446	金证股份	30,358	351,242.06	0.21
202	600057	厦门象屿	52,100	349,591.00	0.20
203	603228	景旺电子	15,480	349,228.80	0.20



204	603026	胜华新材	7,500	343,950.00	0.20
205	600179	安通控股	136,300	340,750.00	0.20
206	600120	浙江东方	94,224	338,264.16	0.20
207	603305	旭升集团	17,128	337,935.44	0.20
208	600064	南京高科	55,700	336,428.00	0.20
209	600993	马应龙	13,908	336,295.44	0.20
210	603678	火炬电子	12,700	336,169.00	0.20
211	601098	中南传媒	33,000	335,610.00	0.20
212	601137	博威合金	21,600	335,448.00	0.20
213	603707	健友股份	22,315	334,725.00	0.20
214	600216	浙江医药	31,035	333,005.55	0.19
215	688083	中望软件	3,335	331,965.90	0.19
216	688568	中科星图	6,713	329,339.78	0.19
217	688700	东威科技	5,345	326,151.90	0.19
218	600967	内蒙一机	39,192	323,725.92	0.19
219	688779	长远锂科	44,346	323,725.80	0.19
220	601156	东航物流	21,900	323,682.00	0.19
221	603690	至纯科技	12,480	320,736.00	0.19
222	688388	嘉元科技	15,786	320,140.08	0.19
223	603565	中谷物流	38,623	317,867.29	0.19
224	600328	中盐化工	40,630	317,726.60	0.19
225	688518	联赢激光	15,500	317,440.00	0.19
226	600562	国睿科技	22,900	316,936.00	0.19
227	600577	精达股份	76,500	316,710.00	0.18
228	600409	三友化工	56,861	312,166.89	0.18
229	601928	凤凰传媒	35,100	309,231.00	0.18
230	601187	厦门银行	60,700	307,749.00	0.18
231	600586	金晶科技	46,000	307,280.00	0.18
232	601908	京运通	66,600	304,362.00	0.18
233	688778	厦钨新能	7,649	303,206.36	0.18
234	600782	新钢股份	86,800	302,932.00	0.18
235	600459	贵研铂业	21,029	301,976.44	0.18
236	688575	亚辉龙	13,135	300,397.45	0.18
237	600663	陆家嘴	34,140	298,725.00	0.17
238	603529	爱玛科技	11,870	297,224.80	0.17
239	600740	山西焦化	58,895	296,830.80	0.17
240	600095	湘财股份	39,500	296,645.00	0.17
241	600507	方大特钢	64,303	296,436.83	0.17
242	600556	天下秀	49,900	294,909.00	0.17
243	688208	道通科技	12,377	293,953.75	0.17
244	603218	日月股份	23,700	293,169.00	0.17
245	603919	金徽酒	11,700	288,054.00	0.17
246	603348	文灿股份	7,300	283,240.00	0.17

247	603866	桃李面包	36,778	281,719.48	0.16
248	600248	陕建股份	69,400	278,988.00	0.16
249	600366	宁波韵升	35,800	278,166.00	0.16
250	600211	西藏药业	5,700	278,160.00	0.16
251	601019	山东出版	28,800	270,144.00	0.16
252	600888	新疆众和	37,200	269,328.00	0.16
253	603128	华贸物流	36,370	268,774.30	0.16
254	600968	海油发展	93,500	266,475.00	0.16
255	688289	圣湘生物	13,590	265,684.50	0.16
256	600428	中远海特	49,400	264,784.00	0.15
257	600295	鄂尔多斯	27,279	264,606.30	0.15
258	600729	重庆百货	9,370	264,234.00	0.15
259	603786	科博达	3,700	264,032.00	0.15
260	688006	杭可科技	11,200	262,976.00	0.15
261	600210	紫江企业	55,800	262,260.00	0.15
262	688123	聚辰股份	4,272	261,574.56	0.15
263	603556	海兴电力	9,010	261,560.30	0.15
264	688348	昱能科技	2,130	260,669.40	0.15
265	601952	苏垦农发	25,400	260,096.00	0.15
266	601311	骆驼股份	32,430	259,764.30	0.15
267	688630	芯碁微装	3,030	258,671.10	0.15
268	600502	安徽建工	55,268	256,996.20	0.15
269	603876	鼎胜新材	20,400	255,612.00	0.15
270	605123	派克新材	2,800	255,360.00	0.15
271	688690	纳微科技	9,296	254,896.32	0.15
272	603881	数据港	12,688	251,476.16	0.15
273	600477	杭萧钢构	76,330	251,125.70	0.15
274	688707	振华新材	12,146	248,993.00	0.15
275	600776	东方通信	22,000	248,380.00	0.15
276	600389	江山股份	14,265	248,211.00	0.14
277	688439	振华风光	2,784	248,082.24	0.14
278	601702	华峰铝业	13,800	247,710.00	0.14
279	600773	西藏城投	22,600	247,696.00	0.14
280	600531	豫光金铅	40,100	242,605.00	0.14
281	603888	新华网	9,600	241,824.00	0.14
282	603713	密尔克卫	4,500	239,445.00	0.14
283	603018	华设集团	31,500	239,400.00	0.14
284	603619	中曼石油	12,900	238,908.00	0.14
285	688318	财富趋势	1,879	237,317.70	0.14
286	603738	泰晶科技	14,340	234,459.00	0.14
287	600377	宁沪高速	22,850	234,212.50	0.14
288	688559	海目星	6,549	233,799.30	0.14
289	603383	顶点软件	4,700	231,710.00	0.14

290	688239	航宇科技	4,850	231,684.50	0.14
291	603612	索通发展	14,900	229,311.00	0.13
292	688696	极米科技	2,002	226,185.96	0.13
293	600223	福瑞达	23,400	225,342.00	0.13
294	688131	皓元医药	4,198	218,547.88	0.13
295	600350	山东高速	31,150	216,181.00	0.13
296	605168	三人行	3,368	213,396.48	0.12
297	603008	喜临门	12,500	212,625.00	0.12
298	600987	航民股份	24,200	211,992.00	0.12
299	688202	美迪西	3,097	211,772.86	0.12
300	600927	永安期货	13,400	210,514.00	0.12
301	603056	德邦股份	14,200	205,474.00	0.12
302	688383	新益昌	1,958	205,178.82	0.12
303	603043	广州酒家	10,500	205,065.00	0.12
304	603801	志邦家居	12,018	201,541.86	0.12
305	688298	东方生物	5,610	200,613.60	0.12
306	601298	青岛港	32,200	198,996.00	0.12
307	600284	浦东建设	31,284	197,089.20	0.12
308	603317	天味食品	14,676	195,044.04	0.11
309	603906	龙蟠科技	15,600	194,376.00	0.11
310	603187	海容冷链	12,480	189,196.80	0.11
311	601882	海天精工	7,200	188,280.00	0.11
312	601139	深圳燃气	26,500	182,585.00	0.11
313	600955	维远股份	10,100	181,295.00	0.11
314	603229	奥翔药业	13,640	180,184.40	0.11
315	600007	中国国贸	9,273	179,710.74	0.10
316	603920	世运电路	9,750	178,230.00	0.10
317	688800	瑞可达	4,427	177,876.86	0.10
318	603583	捷昌驱动	8,872	177,706.16	0.10
319	688295	中复神鹰	5,827	176,616.37	0.10
320	603010	万盛股份	16,300	175,877.00	0.10
321	688356	键凯科技	1,634	173,857.60	0.10
322	600648	外高桥	17,214	169,730.04	0.10
323	603730	岱美股份	11,706	169,619.94	0.10
324	601015	陕西黑猫	37,500	168,000.00	0.10
325	603989	艾华集团	7,400	159,248.00	0.09
326	600639	浦东金桥	15,682	158,545.02	0.09
327	603733	仙鹤股份	9,700	156,558.00	0.09
328	603708	家家悦	11,960	156,317.20	0.09
329	601869	长飞光纤	5,600	153,776.00	0.09
330	603387	基蛋生物	13,978	153,758.00	0.09
331	688268	华特气体	2,276	153,356.88	0.09
332	603915	国茂股份	9,180	151,286.40	0.09

333	600662	外服控股	31,500	151,200.00	0.09
334	601158	重庆水务	26,500	150,255.00	0.09
335	603399	吉翔股份	14,300	146,289.00	0.09
336	603609	禾丰股份	16,900	144,664.00	0.08
337	603439	贵州三力	7,500	141,600.00	0.08
338	688035	德邦科技	2,651	141,457.36	0.08
339	600658	电子城	30,900	138,123.00	0.08
340	603281	江瀚新材	5,200	136,708.00	0.08
341	603025	大豪科技	10,240	135,782.40	0.08
342	600956	新天绿能	16,200	131,706.00	0.08
343	688526	科前生物	6,418	130,798.84	0.08
344	688368	晶丰明源	1,200	129,528.00	0.08
345	603489	八方股份	2,340	128,583.00	0.08
346	603938	三孚股份	7,020	126,219.60	0.07
347	603327	福蓉科技	9,402	125,328.66	0.07
348	603170	宝立食品	7,400	125,134.00	0.07
349	603060	国检集团	14,761	123,992.40	0.07
350	601330	绿色动力	18,200	120,848.00	0.07
351	603429	集友股份	14,480	120,473.60	0.07
352	600853	龙建股份	28,000	119,560.00	0.07
353	603515	欧普照明	6,850	119,053.00	0.07
354	603355	莱克电气	5,320	118,636.00	0.07
355	603071	物产环能	7,700	117,040.00	0.07
356	603357	设计总院	12,932	115,094.80	0.07
357	605222	起帆电缆	5,800	111,824.00	0.07
358	603868	飞科电器	2,200	111,100.00	0.06
359	605009	豪悦护理	2,900	110,693.00	0.06
360	603032	德新科技	5,387	109,356.10	0.06
361	688499	利元亨	2,859	108,870.72	0.06
362	600510	黑牡丹	19,100	107,915.00	0.06
363	601512	中新集团	13,800	106,398.00	0.06
364	605337	李子园	7,230	101,870.70	0.06
365	601065	江盐集团	8,900	101,816.00	0.06
366	601811	新华文轩	7,300	99,718.00	0.06
367	603916	苏博特	9,660	98,435.40	0.06
368	688248	南网科技	3,848	96,084.56	0.06
369	688399	硕世生物	1,681	91,715.36	0.05
370	600370	三房巷	35,800	86,636.00	0.05
371	600032	浙江新能	10,000	80,600.00	0.05
372	603681	永冠新材	5,300	80,030.00	0.05
373	605399	晨光新材	5,700	77,292.00	0.05
374	603230	内蒙新华	4,900	75,950.00	0.04
375	601022	宁波远洋	6,600	73,194.00	0.04

376	603180	金牌厨柜	2,860	71,757.40	0.04
377	688152	麒麟信安	1,017	71,261.19	0.04
378	605089	味知香	1,894	69,206.76	0.04
379	688196	卓越新能	1,615	54,215.55	0.03
380	605099	共创草坪	2,000	40,360.00	0.02

### 8.3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	600886	国投电力	1,634,220.00	0.99
2	601916	浙商银行	1,611,999.00	0.98
3	600926	杭州银行	1,495,881.00	0.91
4	601901	方正证券	1,165,059.00	0.71
5	688072	拓荆科技	1,158,841.15	0.70
6	600741	华域汽车	1,111,113.00	0.67
7	600161	天坛生物	1,109,429.00	0.67
8	600109	国金证券	1,052,575.00	0.64
9	688169	石头科技	980,347.21	0.59
10	600372	中航机载	947,270.00	0.57
11	688120	华海清科	921,497.02	0.56
12	601838	成都银行	895,786.00	0.54
13	601699	潞安环能	851,795.00	0.52
14	600873	梅花生物	841,135.00	0.51
15	600129	太极集团	807,354.00	0.49
16	688617	惠泰医疗	805,819.65	0.49
17	601865	福莱特	740,818.00	0.45
18	600499	科达制造	690,347.00	0.42
19	600884	杉杉股份	657,996.00	0.40
20	603077	和邦生物	625,805.00	0.38

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。

### 8.4.2 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	601138	工业富联	3,744,237.00	2.27
2	688036	传音控股	1,883,839.11	1.14
3	601555	东吴证券	1,410,136.00	0.85
4	688122	西部超导	1,099,869.40	0.67
5	603596	伯特利	1,001,842.00	0.61
6	600332	白云山	995,905.00	0.60
7	600415	小商品城	986,158.00	0.60
8	600027	华电国际	937,339.00	0.57
9	600754	锦江酒店	920,449.00	0.56
10	603605	珀莱雅	911,360.24	0.55
11	603939	益丰药房	857,951.85	0.52
12	600705	中航产融	811,248.00	0.49
13	603688	石英股份	801,607.00	0.49
14	600160	巨化股份	765,880.00	0.46
15	601998	中信银行	755,382.00	0.46
16	600895	张江高科	732,233.00	0.44
17	600026	中远海能	713,961.00	0.43
18	688390	固德威	688,983.87	0.42
19	600711	盛屯矿业	628,127.00	0.38
20	600155	华创云信	592,405.00	0.36

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。

### 8.4.3 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	50,144,420.93
卖出股票收入（成交）总额	47,426,017.19

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。

### 8.5 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）	45,002.96	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	45,002.96	0.03

## 8.6 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	113069	博 23 转债	450	45,002.96	0.03

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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，上海银行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上海市分局的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	130,858.70
2	应收清算款	-
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	130,858.70

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 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。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。



## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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		南方上证 380 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
1,028	89,930.85	3,171,489.00	3.43%	10,763,985.00	11.64%	78,513,441.00	84.93%

### 9.2 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	806,500.00	0.87%
2	中信证券股份有限公司	700,126.00	0.76%
3	陈宽军	651,200.00	0.70%
4	北京无限立通通讯技术有限责任公司	609,600.00	0.66%
5	华泰证券股份有限公司	385,800.00	0.42%
6	米润生	384,400.00	0.42%
7	广发证券股份有限公司	357,400.00	0.39%
8	海通证券股份有限公司	311,200.00	0.34%
9	张培良	300,000.00	0.32%
10	陈裕发	286,900.00	0.31%
11	中国建设银行股份有限公司-南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	78,513,441.00	84.93%

注：持有人名称与注册登记机构持有人名册保持一致。其中：“中国建设银行股份有限公司-南方上证 380 交易型开放式指数证券”对应的基金全称为“中国建设银行股份有限公司-南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。

### 9.3 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。

### 9.4 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。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年9月16日)基金份额总额	330,448,915.00
本报告期期初基金份额总额	84,448,915.00
本报告期基金总申购份额	14,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	6,000,000.00
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	92,448,915.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 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根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化,目前普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务 13 年,本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 30,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理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。

### 11.6.2 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,基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	95,816,523.11	98.61%	9,564.32	97.47%	-
华泰证券	2	1,214,225.00	1.25%	121.38	1.24%	-
国金证券	1	137,297.13	0.14%	126.52	1.29%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
麦高证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	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:

申万宏源

退租交易单元:

无

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	438,282.04	80.61%	-	-	-	-
华泰证券	105,428.45	19.39%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
麦高证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

中邮证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

### 11.8 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	南方基金关于上证 380 交易型开放式指数证券投资基金增加国泰君安为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	2023-01-18
2	关于南方基金管理股份有限公司旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-08
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	2023-02-25
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-18
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	2023-03-23
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-20
7	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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-26
8	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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-30
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金参与浙商银行股份有限公司配股的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-28
10	南方基金关于旗下部分基金增加德邦证券为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	2023-07-11
11	南方基金关于旗下部分基金增加开源证券为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	2023-07-25
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	2023-07-26
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	2023-08-11

		基金电子披露网站	
14	南方基金管理股份有限公司关于运用自有资金投资旗下基金的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-21
15	南方基金管理股份有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-09-07
16	南方基金管理股份有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-09-07
17	南方基金管理股份有限公司关于运用自有资金投资旗下权益类公募基金的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-03
18	南方基金关于旗下部分基金增加财达证券为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	2023-11-16
19	南方基金关于旗下部分基金增加安信证券为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	2023-11-22
20	南方基金关于旗下部分基金增加中泰证券为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	2023-12-04
21	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-15
22	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加万联证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-21

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20230101-20231231	73,036,841.00	10,000,000.00	4,523,400.00	78,513,441.00	84.93%
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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立上证 380 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《上证 380 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、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告》原文。

### 13.2 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。

### 13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>