

# 南方中证 500 增强策略交易型开放式 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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.....	9
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.....	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.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
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.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§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.....	14
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 净资产变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§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.....	51
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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
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.....	70
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.....	70
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.....	70
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.....	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
8.12 投资组合报告附注.....	70
§9 基金份额持有人信息.....	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
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.....	72
§10 开放式基金份额变动.....	72
§11 重大事件揭示.....	73
11.1 基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
11.4 基金投资策略的改变.....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	73
11.8 其他重大事件.....	75
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
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.....	77
§13 备查文件目录.....	77
13.1 备查文件目录.....	77
13.2 存放地点.....	77
13.3 查阅方式.....	77

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 500 增强策略 ETF
场内简称	增强 ETF；中证 500 增强 ETF
基金主代码	560100
交易代码	560100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 1 月 26 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	130,080,333.00 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	2022 年 2 月 16 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强策略交易型开放式指数证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%。
投资策略	本基金主要通过量化投资模型，在控制组合跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。主要投资策略包括：1、以增强指数投资收益为目的的股票投资策略；2、金融衍生品投资策略；3、债券投资策略；4、转融通证券出借业务投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、存托凭证投资策略
业绩比较基准	比较基准的标的指数：中证 500 指数 本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，一般而言，其风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
		郭明
		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	证券日报
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 1 月 26 日-2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-3,683,327.86	-7,926,165.23
本期利润	-2,301,712.23	-12,243,202.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0187	-0.0615
本期加权平均净值利润率	-2.02%	-6.42%
本期基金份额净值增长率	-3.87%	-9.76%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	-17,230,140.90	-13,425,273.46
期末可供分配基金份额利润	-0.1325	-0.0976
期末基金资产净值	112,850,192.10	124,155,059.54
期末基金份额净值	0.8675	0.9024
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	-13.25%	-9.76%

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

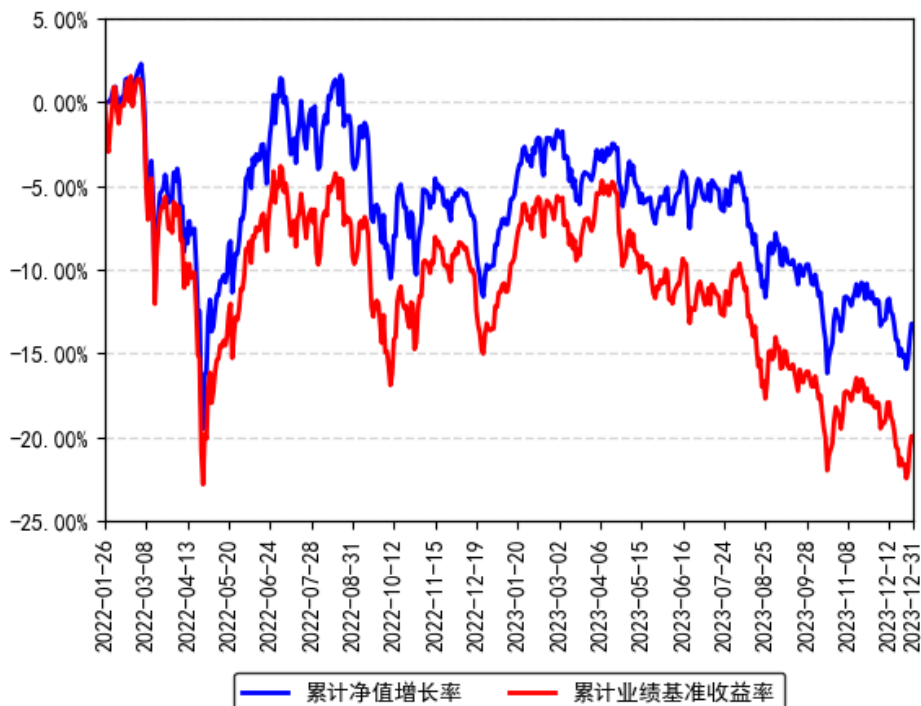
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.93%	0.80%	-4.60%	0.86%	0.67%	-0.06%
过去六个月	-8.69%	0.78%	-9.49%	0.86%	0.80%	-0.08%
过去一年	-3.87%	0.75%	-7.42%	0.82%	3.55%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-13.25%	1.07%	-19.95%	1.13%	6.70%	-0.06%

##### 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

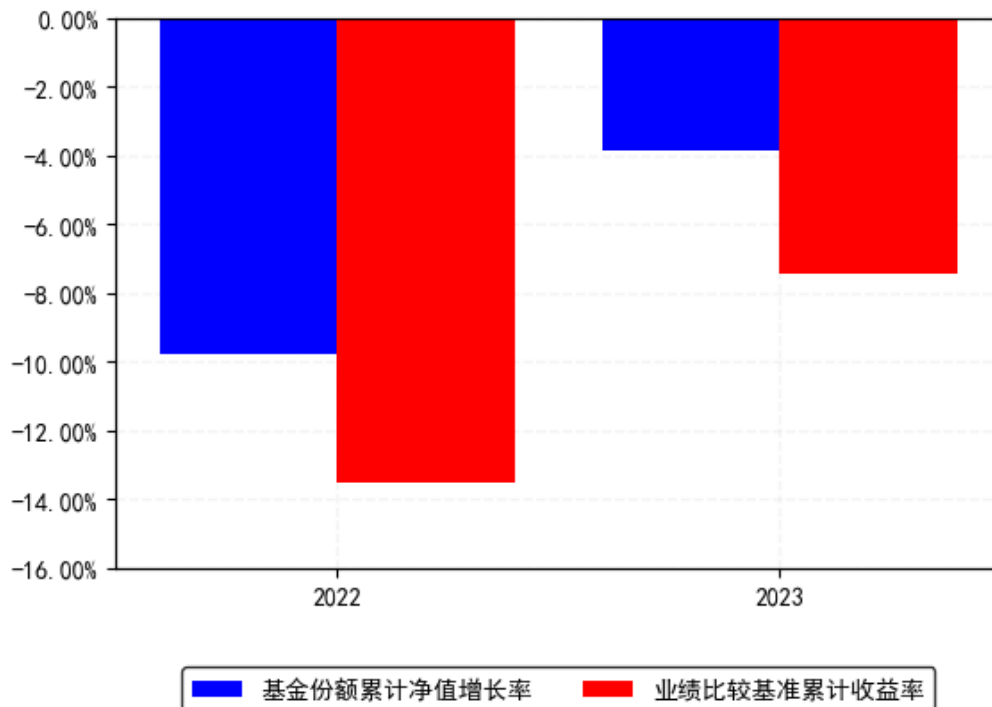
### 基准收益率变动的比较

南方中证500增强策略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



### 3.2.3 自基金合同生效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

南方中证500增强策略ETF每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2022 年 1 月 26 日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

## § 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		
崔蕾	本基金基金经理	2022 年 1 月 26 日	-	8 年	女，康奈尔大学金融工程硕士，金融风险经理（FRM），特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 4 月 23 日，任南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2019 年 6 月 28 日至 2022 年 2 月 18 日，任大数据 300 基金经理；2020 年 3 月 26 日至 2023 年 3 月 27 日，任南方粤港澳大湾区联接基金经理；2019 年 11 月 29 日至 2023 年 7 月 4 日，任南方粤港澳大湾区 ETF 基金经理；2018 年 11 月 8 日至 2023 年 12 月 29 日，任南方中证 500 增强基金经理；2022 年 12 月 1 日至 2023 年 12 月 29 日，任南方上证科创板 50 成份增强策略 ETF 基金经理；2019

				<p>年 6 月 12 日至今，任南方顶峰 TOPIX ETF (QDII) 基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任有色金属、南方有色金属联接、1000ETF 基金经理；2020 年 1 月 17 日至今，任红利 50 基金经理；2020 年 1 月 21 日至今，任南方大盘红利 50 基金经理；2021 年 6 月 24 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 基金经理；2021 年 8 月 19 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 联接基金经理；2021 年 9 月 27 日至今，任南方中证 1000 联接基金经理；2021 年 12 月 29 日至今，任南方国证在线消费 ETF 基金经理；2022 年 1 月 26 日至今，任南方中证 500 增强策略 ETF 基金经理；2022 年 11 月 23 日至今，任南方国证交通运输行业 ETF 基金经理；2023 年 11 月 24 日至今，任南方国证交通运输行业 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

本报告期内指数涨跌幅-7.42%，产品净值涨跌幅-3.87%，超额收益 3.55%。2023 年受地缘冲突、疫情反复等多因素影响，A 股市场波动较大，且各类风格轮动较快，获取超额收益的难度继续增加。

在当前市场存在较大不确定性的行情下，本基金在风格和行业的配置上仍维持了均衡比例，并紧密跟踪市场动态。

#### 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 0.8675 元，报告期内，份额净值增长率为-3.87%，同期业绩基准增长率为-7.42%。

#### 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，宏观层面上，我国经济整体保持弱复苏节奏，货币政策仍维持 2019 年以来的降息趋势，流动性中短期保持充裕，中长期贷款总体处于筑底阶段，形成宽货币+紧信用大环境。估值层面上，当前中证 500 为代表的中盘指数市盈率分位数在 P20 以下，安全边际较高。

本基金为增强策略交易型开放式指数证券投资基金，作为基金管理人，我们将在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

#### 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

本报告期内,本基金托管人在对南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中,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,南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方新兴消费增长股票型证券投资基金(LOF)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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告中财务指标、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 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 23244 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	南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南方中证 500 增强策略 ETF 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</p> <p>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,公允反映了南方中证 500 增强策略 ETF 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>
形成审计意见的基础	<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,我们独立于南方中证 500 增强策略 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>南方中证 500 增强策略 ETF 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中证 500 增强策略 ETF 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中证 500 增强策略 ETF 基金、</p>

	<p>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中证 500 增强策略 ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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，就可能对南方中证 500 增强策略 ETF 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中证 500 增强策略 ETF 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：南方中证 500 增强策略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 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	1,656,911.31	1,219,561.60
结算备付金		1,671,503.63	9,440,791.44
存出保证金		418,301.74	1,694,117.05
交易性金融资产	7.4.7.2	109,370,625.63	111,955,770.82
其中：股票投资		109,367,925.43	111,955,770.82
基金投资		-	-
债券投资		2,700.20	-
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		248,657.57	112,894.98
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		113,365,999.88	124,423,135.89
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		1,010.88	15,476.51

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		44,522.74	55,147.22
应付托管费		4,452.27	5,514.74
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	7.4.7.6	465,821.89	191,937.88
负债合计		515,807.78	268,076.35
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	130,080,333.00	137,580,333.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-17,230,140.90	-13,425,273.46
净资产合计		112,850,192.10	124,155,059.54
负债和净资产总计		113,365,999.88	124,423,135.89

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8675 元，基金份额总额 130,080,333.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方中证 500 增强策略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 26 日（基金合同 生效日）至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-1,526,314.71	-11,197,918.33
1.利息收入		63,136.49	726,024.41
其中：存款利息收入	7.4.7.9	63,136.49	355,450.74
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		-	370,573.67
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-3,146,736.18	-9,296,814.30
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-4,571,138.30	-11,834,127.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	33,708.38	162,394.62

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	-870,661.84	-623,980.77
股利收益	7.4.7.14	2,261,355.58	2,998,899.18
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）	7.4.7.15	1,381,615.63	-4,317,037.07
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	175,669.35	1,689,908.63
减：二、营业总支出		775,397.52	1,045,283.97
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	572,577.97	921,891.19
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	57,257.83	92,189.11
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		213.24	0.33
8.其他费用	7.4.7.17	145,348.48	31,203.34
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-2,301,712.23	-12,243,202.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		-2,301,712.23	-12,243,202.30
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-2,301,712.23	-12,243,202.30

### 7.3 净资产变动表

会计主体：南方中证 500 增强策略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	137,580,333.00	-	-13,425,273.46	124,155,059.54
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	137,580,333.00	-	-13,425,273.46	124,155,059.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,500,000.00	-	-3,804,867.44	-11,304,867.44
（一）、综合收益总额	-	-	-2,301,712.23	-2,301,712.23
（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）	-7,500,000.00	-	-1,503,155.21	-9,003,155.21
其中：1.基金申购款	292,500,000.00	-	-20,165,828.32	272,334,171.68
2.基金赎回款	-300,000,000.00	-	18,662,673.11	-281,337,326.89
（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	130,080,333.00	-	-17,230,140.90	112,850,192.10
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	746,580,333.00	-	-	746,580,333.00

资产				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-609,000,000.00	-	-13,425,273.46	-622,425,273.46
（一）、综合收益总额	-	-	-12,243,202.30	-12,243,202.30
（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）	-609,000,000.00	-	-1,182,071.16	-610,182,071.16
其中：1.基金申购款	445,500,000.00	-	-22,984,870.64	422,515,129.36
2.基金赎回款	-1,054,500,000.00	-	21,802,799.48	-1,032,697,200.52
（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	137,580,333.00	-	-13,425,273.46	124,155,059.54

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

南方中证 500 增强策略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[2021]3580 号《关于准予南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 增强策略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 746,577,500.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0042 号验资报告予以验证。经向中

国证监会备案,《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2022 年 1 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 746,580,333.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,833.00 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2022]38 号审核同意,本基金 746,580,333.00 份基金份额于 2022 年 2 月 16 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 增强策略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在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上,力争实现超越目标指数的投资收益;主要投资于标的指数成份股、备选成份股。此外,本基金可少量投资于非成份股(包含主板、创业板及其他经中国证监会核准/注册发行的股票)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可投资存托凭证。本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%,投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产净值的 80%。每个交易日日终,在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 6.5%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率。

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。比较财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。

### 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	1,656,911.31	1,219,561.60
等于: 本金	1,656,752.38	1,219,321.10
加: 应计利息	158.93	240.50
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	1,656,911.31	1,219,561.60

##### 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	112,292,653.54	-	109,367,925.43	-2,924,728.11

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,700.00	0.20	2,700.20	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,700.00	0.20	2,700.20	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		112,295,353.54	0.20	109,370,625.63	-2,924,728.11
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		115,812,371.53	-	111,955,770.82	-3,856,600.71
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		115,812,371.53	-	111,955,770.82	-3,856,600.71

#### 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	3,272,773.33	-	-	-
一指期货	3,272,773.33	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,272,773.33	-	-	-
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	12,209,236.36	-	-	-
—股指期货	12,209,236.36	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	12,209,236.36	-	-	-

#### 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
IC2401	IC2401	3.00	3,262,080.00	-10,693.33
合计				-10,693.33
减：可抵销期货暂收款				-10,693.33
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	8,697.65	43,996.96
其中：交易所市场	8,697.65	43,996.96
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应退退补款	312,124.24	117,940.92
预提费用	145,000.00	30,000.00
应付指数使用费	-	-
可退替代款	-	-
合计	465,821.89	191,937.88

## 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	137,580,333.00	137,580,333.00
本期申购	292,500,000.00	292,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-300,000,000.00	-300,000,000.00
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	130,080,333.00	130,080,333.00

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	-4,964,255.20	-8,461,018.26	-13,425,273.46
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-4,964,255.20	-8,461,018.26	-13,425,273.46
本期利润	-3,683,327.86	1,381,615.63	-2,301,712.23
本期基金份额交易产生的变动数	-603,200.73	-899,954.48	-1,503,155.21
其中：基金申购款	-7,264,028.05	-12,901,800.27	-20,165,828.32
基金赎回款	6,660,827.32	12,001,845.79	18,662,673.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,250,783.79	-7,979,357.11	-17,230,140.90

## 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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	8,742.79	43,383.87
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	53,733.27	309,984.26
其他	660.43	2,082.61
合计	63,136.49	355,450.74

## 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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,128,891.61	-14,793,023.58
股票投资收益——赎回差价收入	-442,246.69	2,958,896.25
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	-4,571,138.30	-11,834,127.33

**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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	701,514,281.93	1,072,467,074.46
减：卖出股票成本总额	704,763,054.90	1,085,699,840.68
减：交易费用	880,118.64	1,560,257.36
买卖股票差价收入	-4,128,891.61	-14,793,023.58

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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	281,337,326.89	1,032,697,200.52
减：现金支付赎回款总额	129,519,234.89	486,200,442.52
减：赎回股票成本总额	152,260,338.69	543,537,861.75
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-442,246.69	2,958,896.25

**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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	20.91	139.26
债券投资收益——买卖债券（、 债转股及债券到期兑付）差价收 入	33,687.47	162,255.36
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	33,708.38	162,394.62

**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 26 日（基金合同生效日）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	191,810.63	1,124,518.14
减：卖出债券（债转股及债 券到期兑付）成本总额	158,100.00	962,100.00
减：应计利息总额	20.99	142.21
减：交易费用	2.17	20.57
买卖债券差价收入	33,687.47	162,255.36

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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	-870,661.84	-623,980.77

**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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,261,355.58	2,998,899.18
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	2,261,355.58	2,998,899.18

**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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	931,872.60	-3,856,600.71
——股票投资	931,872.60	-3,856,600.71
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-

2.衍生工具	449,743.03	-460,436.36
——权证投资	-	-
——期货投资	449,743.03	-460,436.36
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	1,381,615.63	-4,317,037.07

#### 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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	175,669.35	1,501,204.64
其他	-	188,703.99
合计	175,669.35	1,689,908.63

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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	25,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	338.00	803.00
其他	10.48	400.34
合计	145,348.48	31,203.34

### 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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
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

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 26 日 (基金合同生效日) 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	648,483,424.27	46.07%	998,751,727.70	38.53%
兴业证券	508,872,555.96	36.16%	615,170,300.34	23.73%

#### 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 26 日 (基金合同生效日) 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	124,728.15	65.03%	331,397.98	29.47%
兴业证券	15,665.89	8.17%	139,533.82	12.41%

#### 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	64,843.96	46.07%	1,550.16	17.82%
兴业证券	50,899.11	36.16%	4,101.57	47.16%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)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	99,862.64	38.52%	18,535.92	42.13%
兴业证券	61,513.47	23.73%	17,890.38	40.66%

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 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	572,577.97	921,891.19
其中：应支付销售机构的客户维护费	14,647.86	15,741.74
应支付基金管理人的净管理费	557,930.11	906,149.45

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% ÷ 当年天数。

## 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 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	57,257.83	92,189.11

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% \div \text{当年天数}。$$

#### 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	1,600,000.00	1.23%	2,283,600.00	1.66%

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

	月 31 日		(基金合同生效日) 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
中国工商银行	1,656,911.31	8,742.79	1,219,561.60	43,383.87

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	850	85,000.00
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	1,364	44,357.28
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	1,838	38,450.96
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	1,483	28,473.60
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合	127100	神码转债	配债	27	2,700.00
兴业证券,华泰联合	688469	芯联集成	网下申购	12,695	72,234.55

上年度可比期间 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）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
华泰联合	113062	常银转债	配债	2,390	239,000.00
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	6,035	135,968.55
华泰联合	301327	华宝新能	网下申购	483	114,712.50
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	1,417	114,493.60
华泰联合	301195	北路智控	网下申购	950	67,611.50
华泰联合	113659	莱克转债	配债	590	59,000.00
华泰联合	688420	美腾科技	网下申购	860	42,105.60
华泰联合	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
兴业证券	301165	锐捷网络	网下申购	1,766	57,183.08
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
688627	精智达	2023 年 7 月 11 日	6 个月	新股锁定期	46.77	87.72	70	3,273.90	6,140.40	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定期	26.74	38.67	130	3,476.20	5,027.10	-
688563	航材股份	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股锁定期	78.99	60.49	79	6,240.21	4,778.71	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定期	55.00	74.14	60	3,300.00	4,448.40	-
603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁定期	9.50	18.97	117	1,111.50	2,219.49	-
603107	上海汽配	2023 年 10 月 25 日	6 个月	新股锁定期	14.23	18.19	72	1,024.56	1,309.68	-
603193	润本股份	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定期	17.38	16.66	70	1,216.60	1,166.20	-
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
127100	神码转债	2023 年 12 月 21 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.01	27	2,700.00	2,700.20	-

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,紧密跟踪中证 500 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。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会,负责制定风险管理的宏观政策,审议通过风险控制的总体措施等;在管理层层面设立风险控制委员会,讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估,督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制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 0.0024%(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	1,656,911.31	-	-	-	1,656,911.31
结算备付金	1,671,503.63	-	-	-	1,671,503.63
存出保证金	26,852.14	-	-	391,449.60	418,301.74
交易性金融资产	-	-	2,700.20	109,367,925.43	109,370,625.63
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	-	-	-	248,657.57	248,657.57
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,355,267.08	-	2,700.20	110,008,032.60	113,365,999.88
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	-	-	-	1,010.88	1,010.88
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	44,522.74	44,522.74
应付托管费	-	-	-	4,452.27	4,452.27
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	-	-	-	465,821.89	465,821.89
负债总计	-	-	-	515,807.78	515,807.78
利率敏感度缺口	3,355,267.08	-	2,700.20	109,492,224.82	112,850,192.10
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	1,219,561.60	-	-	-	1,219,561.60
结算备付金	9,440,791.44	-	-	-	9,440,791.44
存出保证金	49,285.05	-	-	1,644,832.00	1,694,117.05
交易性金融资产	-	-	-	111,955,770.82	111,955,770.82
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	-	-	-	112,894.98	112,894.98
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,709,638.09	-	-	113,713,497.80	124,423,135.89
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	-	-	-	15,476.51	15,476.51
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	55,147.22	55,147.22
应付托管费	-	-	-	5,514.74	5,514.74
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	-	-	-	191,937.88	191,937.88
负债总计	-	-	-	268,076.35	268,076.35
利率敏感度缺口	10,709,638.09	-	-	113,445,421.45	124,155,059.54

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。

#### 7.4.13.4.3 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。

本基金原则上采用指数复制法，跟踪中证 500 指数，根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产净值的 80%。此外，本基金的基金

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

#### 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	109,367,925.43	96.91	111,955,770.82	90.17
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	109,367,925.43	96.91	111,955,770.82	90.17

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%	4,991,377.52	5,925,077.64
	2.组合自身基准下降 5%	-4,991,377.52	-5,925,077.64

### 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	109,342,835.45	111,785,198.12
第二层次	2,700.20	39,189.00
第三层次	25,089.98	131,383.70
合计	109,370,625.63	111,955,770.82

#### 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	-	131,383.70	131,383.70
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	125,620.20	125,620.20
转出第三层次	-	270,111.31	270,111.31
当期利得或损失总额	-	38,197.39	38,197.39
其中：计入损益的利得或损失	-	38,197.39	38,197.39
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	25,089.98	25,089.98
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	-	5,447.01	5,447.01
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	411,437.82	411,437.82
转出第三层次	-	378,790.59	378,790.59
当期利得或损失总额	-	98,736.47	98,736.47
其中：计入损益的利得或损失	-	98,736.47	98,736.47
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	131,383.70	131,383.70
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	-	5,003.17	5,003.17

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。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	25,089.98	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2146~2.1988	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	131,383.70	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2127~0.7544	负相关

#### 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	109,367,925.43	96.47
	其中：股票	109,367,925.43	96.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,700.20	0.00
	其中：债券	2,700.20	0.00
	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	3,328,414.94	2.94
8	其他资产	666,959.31	0.59
9	合计	113,365,999.88	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	472,974.00	0.42
B	采矿业	3,956,373.00	3.51
C	制造业	70,962,327.76	62.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,734,886.00	2.42
E	建筑业	2,209,436.10	1.96
F	批发和零售业	4,772,859.92	4.23
G	交通运输、仓储和邮政业	2,286,307.00	2.03
H	住宿和餐饮业	71,852.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服	7,586,968.60	6.72

	务业		
J	金融业	7,586,393.35	6.72
K	房地产业	10,848.00	0.01
L	租赁和商务服务业	1,018,608.00	0.90
M	科学研究和技术服务业	506,261.00	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	1,141,113.72	1.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	79,968.00	0.07
Q	卫生和社会工作	456,200.00	0.40
R	文化、体育和娱乐业	3,090,276.00	2.74
S	综合	395,517.00	0.35
	合计	109,339,169.45	96.89

### 8.2.2 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	25,089.98	0.02
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	3,666.00	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	28,755.98	0.03

### 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	601058	赛轮轮胎	71,900	844,825.00	0.75
2	600998	九州通	106,882	749,242.82	0.66
3	600873	梅花生物	76,900	734,395.00	0.65
4	601168	西部矿业	49,200	702,084.00	0.62
5	600820	隧道股份	115,300	664,128.00	0.59
6	601717	郑煤机	52,000	657,800.00	0.58
7	000783	长江证券	121,800	655,284.00	0.58
8	600563	法拉电子	7,000	648,200.00	0.57
9	600170	上海建工	274,200	641,628.00	0.57
10	688516	奥特维	6,837	618,748.50	0.55
11	600398	海澜之家	82,500	612,150.00	0.54
12	300866	安克创新	6,901	611,428.60	0.54
13	600177	雅戈尔	92,800	607,840.00	0.54
14	000997	新大陆	30,100	590,261.00	0.52
15	601231	环旭电子	39,000	589,290.00	0.52
16	600390	五矿资本	125,800	588,744.00	0.52
17	600582	天地科技	106,200	577,728.00	0.51
18	000933	神火股份	34,100	572,880.00	0.51
19	603927	中科软	19,000	569,620.00	0.50
20	300308	中际旭创	5,000	564,550.00	0.50
21	600637	东方明珠	73,600	553,472.00	0.49
22	600373	中文传媒	41,300	544,334.00	0.48
23	600642	申能股份	84,300	541,206.00	0.48
24	002422	科伦药业	18,400	534,520.00	0.47
25	600066	宇通客车	40,300	533,975.00	0.47
26	688301	奕瑞科技	1,639	533,101.14	0.47
27	688009	中国通号	119,865	525,008.70	0.47
28	600566	济川药业	16,700	524,881.00	0.47
29	002128	电投能源	36,600	522,282.00	0.46
30	600985	淮北矿业	31,200	518,856.00	0.46
31	600511	国药股份	18,100	518,022.00	0.46
32	002056	横店东磁	37,400	506,396.00	0.45
33	600131	国网信通	33,400	506,010.00	0.45
34	002138	顺络电子	18,500	499,685.00	0.44
35	601098	中南传媒	49,000	498,330.00	0.44
36	600535	天士力	29,000	493,580.00	0.44

37	000887	中鼎股份	39,800	492,326.00	0.44
38	600655	豫园股份	78,900	489,969.00	0.43
39	600901	江苏金租	100,580	486,807.20	0.43
40	300009	安科生物	47,200	482,384.00	0.43
41	603156	养元饮品	22,600	480,476.00	0.43
42	600060	海信视像	22,800	476,520.00	0.42
43	000513	丽珠集团	13,600	476,136.00	0.42
44	603225	新凤鸣	33,200	471,440.00	0.42
45	600271	航天信息	43,700	464,968.00	0.41
46	601233	桐昆股份	29,800	450,874.00	0.40
47	000728	国元证券	65,500	447,365.00	0.40
48	600707	彩虹股份	66,100	446,175.00	0.40
49	600970	中材国际	45,900	428,706.00	0.38
50	600967	内蒙一机	51,700	427,042.00	0.38
51	000563	陕国投 A	138,900	422,256.00	0.37
52	600764	中国海防	16,900	421,655.00	0.37
53	688819	天能股份	14,960	417,683.20	0.37
54	600348	华阳股份	42,550	415,288.00	0.37
55	600755	厦门国贸	58,900	410,533.00	0.36
56	601598	中国外运	77,900	408,196.00	0.36
57	000987	越秀资本	67,200	404,544.00	0.36
58	600737	中粮糖业	48,800	402,112.00	0.36
59	600380	健康元	32,300	401,489.00	0.36
60	002032	苏泊尔	7,500	397,575.00	0.35
61	002745	木林森	45,800	396,628.00	0.35
62	300888	稳健医疗	10,620	395,595.00	0.35
63	600801	华新水泥	31,700	394,031.00	0.35
64	688002	睿创微纳	8,873	392,364.06	0.35
65	600867	通化东宝	36,000	389,880.00	0.35
66	603444	吉比特	1,570	384,838.40	0.34
67	601666	平煤股份	32,900	380,324.00	0.34
68	300832	新产业	4,800	375,360.00	0.33
69	600499	科达制造	35,100	370,305.00	0.33
70	002439	启明星辰	13,700	369,900.00	0.33
71	000156	华数传媒	50,000	368,500.00	0.33
72	603589	口子窖	8,100	366,930.00	0.33
73	600096	云天化	23,500	366,600.00	0.32
74	600153	建发股份	38,000	365,940.00	0.32
75	000878	云南铜业	33,000	359,370.00	0.32
76	601866	中远海发	152,000	355,680.00	0.32
77	688188	柏楚电子	1,397	353,594.67	0.31
78	002563	森马服饰	60,500	349,085.00	0.31
79	300724	捷佳伟创	4,700	347,847.00	0.31

80	002705	新宝股份	23,800	346,766.00	0.31
81	000932	华菱钢铁	66,700	343,505.00	0.30
82	688289	圣湘生物	17,491	341,949.05	0.30
83	002028	思源电气	6,500	338,260.00	0.30
84	603228	景旺电子	14,908	336,324.48	0.30
85	601869	长飞光纤	12,200	335,012.00	0.30
86	600704	物产中大	75,600	334,908.00	0.30
87	600008	首创环保	124,000	333,560.00	0.30
88	002532	天山铝业	55,300	332,353.00	0.29
89	000581	威孚高科	21,800	328,526.00	0.29
90	600409	三友化工	58,900	323,361.00	0.29
91	603355	莱克电气	14,200	316,660.00	0.28
92	002867	周大生	20,800	315,744.00	0.28
93	002078	太阳纸业	25,800	313,986.00	0.28
94	603688	石英股份	3,598	312,594.24	0.28
95	002595	豪迈科技	10,500	312,585.00	0.28
96	603866	桃李面包	40,740	312,068.40	0.28
97	601636	旗滨集团	45,300	309,852.00	0.27
98	601000	唐山港	88,200	308,700.00	0.27
99	600507	方大特钢	66,800	307,948.00	0.27
100	600623	华谊集团	47,000	302,680.00	0.27
101	600282	南钢股份	81,700	302,290.00	0.27
102	603658	安图生物	5,300	302,153.00	0.27
103	601019	山东出版	31,900	299,222.00	0.27
104	603568	伟明环保	18,700	299,200.00	0.27
105	002690	美亚光电	15,170	297,938.80	0.26
106	002600	领益智造	43,800	296,088.00	0.26
107	000423	东阿阿胶	6,000	295,920.00	0.26
108	002203	海亮股份	26,400	294,360.00	0.26
109	002294	信立泰	9,000	293,940.00	0.26
110	000959	首钢股份	84,900	293,754.00	0.26
111	000039	中集集团	38,000	290,700.00	0.26
112	601958	金铂股份	30,700	290,115.00	0.26
113	600298	安琪酵母	8,228	289,461.04	0.26
114	688169	石头科技	1,018	288,043.10	0.26
115	000785	居然之家	87,000	287,100.00	0.25
116	600521	华海药业	19,500	286,065.00	0.25
117	600741	华域汽车	17,500	284,900.00	0.25
118	600546	山煤国际	16,000	280,160.00	0.25
119	601966	玲珑轮胎	14,500	278,835.00	0.25
120	300296	利亚德	46,100	276,600.00	0.25
121	600350	山东高速	39,800	276,212.00	0.24
122	002185	华天科技	32,200	274,344.00	0.24

123	600808	马钢股份	100,000	272,000.00	0.24
124	603712	七一二	8,600	270,986.00	0.24
125	000830	鲁西化工	27,000	270,810.00	0.24
126	002025	航天电器	5,600	268,912.00	0.24
127	603529	爱玛科技	10,700	267,928.00	0.24
128	002373	千方科技	23,800	266,798.00	0.24
129	600529	山东药玻	10,400	266,240.00	0.24
130	601108	财通证券	34,000	263,840.00	0.23
131	600673	东阳光	35,700	261,681.00	0.23
132	688029	南微医学	2,703	261,650.40	0.23
133	300682	朗新集团	15,800	258,962.00	0.23
134	605358	立昂微	9,400	257,466.00	0.23
135	002925	盈趣科技	13,200	257,004.00	0.23
136	000960	锡业股份	17,900	256,328.00	0.23
137	002080	中材科技	16,100	256,312.00	0.23
138	600166	福田汽车	91,600	250,068.00	0.22
139	000778	新兴铸管	63,700	243,334.00	0.22
140	002266	浙富控股	70,900	241,060.00	0.21
141	000738	航发控制	12,100	240,790.00	0.21
142	600038	中直股份	6,200	238,886.00	0.21
143	601179	中国西电	48,000	236,640.00	0.21
144	000559	万向钱潮	45,500	236,145.00	0.21
145	600486	扬农化工	3,710	234,175.20	0.21
146	688772	珠海冠宇	10,633	234,032.33	0.21
147	603868	飞科电器	4,600	232,300.00	0.21
148	000967	盈峰环境	48,900	232,275.00	0.21
149	002958	青农商行	88,500	231,870.00	0.21
150	603338	浙江鼎力	4,500	230,265.00	0.20
151	603233	大参林	9,220	229,578.00	0.20
152	002384	东山精密	12,400	225,432.00	0.20
153	688521	芯原股份	4,455	222,571.80	0.20
154	603893	瑞芯微	3,500	221,900.00	0.20
155	600871	石化油服	120,400	220,332.00	0.20
156	002408	齐翔腾达	41,700	220,176.00	0.20
157	603661	恒林股份	4,900	218,393.00	0.19
158	600598	北大荒	18,200	217,854.00	0.19
159	300529	健帆生物	9,800	217,854.00	0.19
160	000937	冀中能源	30,400	217,056.00	0.19
161	600959	江苏有线	69,000	216,660.00	0.19
162	603100	川仪股份	7,800	216,216.00	0.19
163	603786	科博达	3,000	214,080.00	0.19
164	002030	达安基因	22,000	212,960.00	0.19
165	000630	铜陵有色	64,800	212,544.00	0.19



166	601608	中信重工	55,000	212,300.00	0.19
167	600500	中化国际	47,900	211,718.00	0.19
168	688200	华峰测控	1,704	209,251.20	0.19
169	603920	世运电路	11,400	208,392.00	0.18
170	000050	深天马 A	19,500	207,675.00	0.18
171	300558	贝达药业	4,000	206,200.00	0.18
172	002506	协鑫集成	75,100	205,774.00	0.18
173	002372	伟星新材	14,200	205,474.00	0.18
174	002985	北摩高科	5,900	204,612.00	0.18
175	600157	永泰能源	149,100	204,267.00	0.18
176	600782	新钢股份	58,500	204,165.00	0.18
177	300618	寒锐钴业	7,200	203,688.00	0.18
178	000636	风华高科	14,900	203,534.00	0.18
179	603093	南华期货	16,900	202,800.00	0.18
180	000598	兴蓉环境	35,400	201,426.00	0.18
181	688779	长远锂科	27,305	199,326.50	0.18
182	601928	凤凰传媒	22,600	199,106.00	0.18
183	601298	青岛港	32,000	197,760.00	0.18
184	600143	金发科技	24,700	197,353.00	0.17
185	600418	江淮汽车	12,200	197,030.00	0.17
186	600927	永安期货	12,500	196,375.00	0.17
187	601555	东吴证券	26,800	195,908.00	0.17
188	300418	昆仑万维	5,200	194,480.00	0.17
189	688536	思瑞浦	1,321	193,262.30	0.17
190	002653	海思科	8,300	192,145.00	0.17
191	000400	许继电气	8,700	191,052.00	0.17
192	603897	长城科技	9,300	190,464.00	0.17
193	600699	均胜电子	10,600	190,376.00	0.17
194	600161	天坛生物	6,100	188,734.00	0.17
195	000567	海德股份	17,645	187,566.35	0.17
196	000547	航天发展	22,300	186,651.00	0.17
197	300259	新天科技	51,400	186,582.00	0.17
198	600079	人福医药	7,500	186,450.00	0.17
199	002850	科达利	2,200	185,812.00	0.16
200	688778	厦钨新能	4,684	185,673.76	0.16
201	603816	顾家家居	5,300	185,500.00	0.16
202	000012	南玻 A	33,100	184,367.00	0.16
203	600879	航天电子	23,800	183,498.00	0.16
204	000970	中科三环	17,700	183,195.00	0.16
205	002273	水晶光电	13,500	182,790.00	0.16
206	600909	华安证券	37,400	182,512.00	0.16
207	002299	圣农发展	10,500	180,390.00	0.16
208	300741	华宝股份	8,400	179,844.00	0.16

209	600141	兴发集团	9,800	178,850.00	0.16
210	002152	广电运通	14,400	176,544.00	0.16
211	600502	安徽建工	37,700	175,305.00	0.16
212	603886	元祖股份	9,600	175,008.00	0.16
213	300695	兆丰股份	3,300	174,768.00	0.15
214	300795	米奥会展	4,700	173,289.00	0.15
215	300073	当升科技	4,500	171,900.00	0.15
216	601319	中国人保	34,900	168,916.00	0.15
217	000027	深圳能源	26,100	168,345.00	0.15
218	002831	裕同科技	6,100	167,811.00	0.15
219	002557	洽洽食品	4,800	167,136.00	0.15
220	600392	盛和资源	16,400	166,952.00	0.15
221	000988	华工科技	5,600	166,656.00	0.15
222	002414	高德红外	22,400	163,520.00	0.14
223	000958	电投产融	41,500	163,510.00	0.14
224	601339	百隆东方	33,300	162,171.00	0.14
225	000703	恒逸石化	24,000	161,280.00	0.14
226	601139	深圳燃气	23,300	160,537.00	0.14
227	603939	益丰药房	4,000	160,160.00	0.14
228	300861	美畅股份	4,800	159,792.00	0.14
229	002463	沪电股份	7,200	159,264.00	0.14
230	300244	迪安诊断	6,600	157,146.00	0.14
231	300088	长信科技	23,400	156,546.00	0.14
232	600021	上海电力	18,500	156,510.00	0.14
233	603757	大元泵业	6,400	155,136.00	0.14
234	002340	格林美	28,200	153,972.00	0.14
235	003019	宸展光电	6,800	153,680.00	0.14
236	601997	贵阳银行	29,800	153,172.00	0.14
237	600885	宏发股份	5,500	152,020.00	0.13
238	600195	中牧股份	12,800	151,808.00	0.13
239	600517	国网英大	31,800	151,686.00	0.13
240	002543	万和电气	17,000	151,640.00	0.13
241	600109	国金证券	16,700	151,636.00	0.13
242	600056	中国医药	13,500	150,795.00	0.13
243	603611	诺力股份	7,900	149,547.00	0.13
244	300677	英科医疗	6,400	149,504.00	0.13
245	002533	金杯电工	18,500	149,480.00	0.13
246	002572	索菲亚	9,300	148,335.00	0.13
247	300502	新易盛	3,000	147,960.00	0.13
248	002306	中科云网	25,300	147,499.00	0.13
249	600528	中铁工业	19,800	147,312.00	0.13
250	000975	银泰黄金	9,800	147,000.00	0.13
251	002416	爱施德	15,800	146,782.00	0.13

252	600580	卧龙电驱	12,500	146,625.00	0.13
253	300532	今天国际	8,900	146,138.00	0.13
254	002034	旺能环境	9,500	144,875.00	0.13
255	600988	赤峰黄金	10,200	142,902.00	0.13
256	002815	崇达技术	14,900	142,742.00	0.13
257	600171	上海贝岭	10,000	142,200.00	0.13
258	600536	中国软件	3,900	141,414.00	0.13
259	601568	北元集团	29,700	140,778.00	0.12
260	603218	日月股份	11,300	139,781.00	0.12
261	600481	双良节能	16,500	139,590.00	0.12
262	600352	浙江龙盛	16,500	138,600.00	0.12
263	600377	宁沪高速	13,500	138,375.00	0.12
264	601718	际华集团	48,700	138,308.00	0.12
265	603638	艾迪精密	8,500	138,125.00	0.12
266	600160	巨化股份	8,300	136,867.00	0.12
267	000623	吉林敖东	9,000	136,260.00	0.12
268	600299	安迪苏	17,000	136,000.00	0.12
269	600750	江中药业	6,500	135,720.00	0.12
270	000739	普洛药业	8,800	135,432.00	0.12
271	688015	交控科技	7,163	134,377.88	0.12
272	000009	中国宝安	11,400	133,836.00	0.12
273	000060	中金岭南	30,600	132,192.00	0.12
274	603922	金鸿顺	5,000	132,100.00	0.12
275	603596	伯特利	1,900	131,670.00	0.12
276	601158	重庆水务	23,000	130,410.00	0.12
277	601162	天风证券	42,200	130,398.00	0.12
278	688122	西部超导	2,427	129,189.21	0.11
279	688057	金达莱	9,092	128,742.72	0.11
280	002156	通富微电	5,500	127,160.00	0.11
281	300389	艾比森	7,300	126,582.00	0.11
282	300012	华测检测	8,900	126,380.00	0.11
283	601828	美凯龙	32,600	126,162.00	0.11
284	600765	中航重机	6,600	126,126.00	0.11
285	300003	乐普医疗	7,800	126,048.00	0.11
286	601126	四方股份	8,900	126,024.00	0.11
287	002966	苏州银行	19,500	125,970.00	0.11
288	603855	华荣股份	6,300	125,748.00	0.11
289	601077	渝农商行	30,700	125,256.00	0.11
290	600372	中航机载	9,500	125,210.00	0.11
291	002249	大洋电机	25,000	124,250.00	0.11
292	688180	君实生物	2,961	123,858.63	0.11
293	688055	龙腾光电	25,273	123,332.24	0.11
294	002399	海普瑞	10,500	123,165.00	0.11

295	300037	新宙邦	2,600	122,980.00	0.11
296	600956	新天绿能	15,100	122,763.00	0.11
297	603700	宁水集团	8,600	122,722.00	0.11
298	603989	艾华集团	5,700	122,664.00	0.11
299	600482	中国动力	6,800	122,468.00	0.11
300	600295	鄂尔多斯	12,600	122,220.00	0.11
301	603357	设计总院	13,700	121,930.00	0.11
302	002932	明德生物	5,300	121,741.00	0.11
303	300257	开山股份	7,700	121,352.00	0.11
304	603267	鸿远电子	2,400	120,480.00	0.11
305	600487	亨通光电	10,000	119,400.00	0.11
306	600415	小商品城	16,300	119,316.00	0.11
307	600562	国睿科技	8,600	119,024.00	0.11
308	603758	秦安股份	10,400	118,976.00	0.11
309	603882	金域医学	1,900	118,883.00	0.11
310	603115	海星股份	8,100	118,584.00	0.11
311	600182	S 佳通	8,000	118,560.00	0.11
312	688107	安路科技	3,215	118,247.70	0.10
313	002625	光启技术	8,000	118,240.00	0.10
314	603096	新经典	6,000	118,080.00	0.10
315	300136	信维通信	5,000	118,000.00	0.10
316	600862	中航高科	5,300	117,395.00	0.10
317	300349	金卡智能	9,400	116,748.00	0.10
318	600120	浙江东方	32,400	116,316.00	0.10
319	688114	华大智造	1,350	116,127.00	0.10
320	601811	新华文轩	8,500	116,110.00	0.10
321	002081	金螳螂	30,800	115,808.00	0.10
322	688276	百克生物	2,108	115,539.48	0.10
323	688375	国博电子	1,452	115,477.56	0.10
324	688099	晶晨股份	1,825	114,299.75	0.10
325	601990	南京证券	14,300	114,114.00	0.10
326	600839	四川长虹	21,500	113,735.00	0.10
327	000869	张裕 A	4,700	113,458.00	0.10
328	600643	爱建集团	22,200	113,220.00	0.10
329	603556	海兴电力	3,900	113,217.00	0.10
330	600576	祥源文旅	15,200	113,088.00	0.10
331	600129	太极集团	2,400	111,504.00	0.10
332	600037	歌华有线	14,400	111,312.00	0.10
333	002884	凌霄泵业	6,400	111,104.00	0.10
334	603360	百傲化学	10,500	110,985.00	0.10
335	301236	软通动力	2,400	110,880.00	0.10
336	002517	恺英网络	9,900	110,583.00	0.10
337	601577	长沙银行	16,200	110,484.00	0.10

338	600369	西南证券	27,000	110,430.00	0.10
339	603787	新日股份	8,800	110,088.00	0.10
340	600551	时代出版	10,100	109,989.00	0.10
341	300394	天孚通信	1,200	109,824.00	0.10
342	600757	长江传媒	14,700	109,515.00	0.10
343	300601	康泰生物	4,000	108,600.00	0.10
344	688078	龙软科技	2,690	108,460.80	0.10
345	600155	华创云信	13,000	108,420.00	0.10
346	688030	山石网科	5,367	107,447.34	0.10
347	603421	鼎信通讯	11,400	107,160.00	0.09
348	688682	霍莱沃	2,243	107,013.53	0.09
349	688225	亚信安全	5,833	106,977.22	0.09
350	002127	南极电商	27,300	106,197.00	0.09
351	002465	海格通信	8,200	105,370.00	0.09
352	601611	中国核建	15,200	105,336.00	0.09
353	002014	永新股份	12,600	105,210.00	0.09
354	000807	云铝股份	8,600	105,092.00	0.09
355	603456	九洲药业	4,300	104,103.00	0.09
356	300285	国瓷材料	4,500	104,040.00	0.09
357	300207	欣旺达	7,000	103,320.00	0.09
358	002385	大北农	17,300	103,108.00	0.09
359	601128	常熟银行	16,100	102,879.00	0.09
360	002044	美年健康	17,100	102,771.00	0.09
361	002938	鹏鼎控股	4,600	102,672.00	0.09
362	603365	水星家纺	7,100	102,098.00	0.09
363	002472	双环传动	3,900	101,478.00	0.09
364	600027	华电国际	19,700	101,258.00	0.09
365	688390	固德威	773	100,938.34	0.09
366	300787	海能实业	6,000	100,920.00	0.09
367	001696	宗申动力	15,200	100,776.00	0.09
368	002738	中矿资源	2,700	100,737.00	0.09
369	002223	鱼跃医疗	2,900	100,282.00	0.09
370	300568	星源材质	6,500	100,230.00	0.09
371	002658	雪迪龙	12,400	99,572.00	0.09
372	002445	中南文化	41,900	99,303.00	0.09
373	603277	银都股份	3,700	99,234.00	0.09
374	002677	浙江美大	9,800	99,078.00	0.09
375	002090	金智科技	9,900	98,802.00	0.09
376	601696	中银证券	9,600	98,784.00	0.09
377	002088	鲁阳节能	6,900	98,325.00	0.09
378	600705	中航产融	31,600	98,276.00	0.09
379	688561	奇安信	2,448	98,140.32	0.09
380	000723	美锦能源	14,700	97,902.00	0.09

381	002797	第一创业	16,800	97,608.00	0.09
382	300768	迪普科技	6,600	97,548.00	0.09
383	300518	新讯达	5,700	97,356.00	0.09
384	603160	汇顶科技	1,400	96,740.00	0.09
385	600884	杉杉股份	7,100	96,702.00	0.09
386	002214	大立科技	8,400	96,348.00	0.09
387	688639	华恒生物	764	96,187.60	0.09
388	002673	西部证券	14,900	94,913.00	0.08
389	300144	宋城演艺	9,600	94,752.00	0.08
390	688072	拓荆科技	407	94,139.10	0.08
391	603606	东方电缆	2,200	94,050.00	0.08
392	000030	富奥股份	17,600	93,984.00	0.08
393	300146	汤臣倍健	5,500	93,665.00	0.08
394	601016	节能风电	31,100	93,300.00	0.08
395	002008	大族激光	4,500	93,240.00	0.08
396	600062	华润双鹤	5,000	93,000.00	0.08
397	001330	博纳影业	12,800	92,160.00	0.08
398	603871	嘉友国际	5,800	91,988.00	0.08
399	600497	驰宏锌锗	18,200	91,910.00	0.08
400	603077	和邦生物	38,800	91,568.00	0.08
401	600583	海油工程	15,400	91,476.00	0.08
402	688220	翱捷科技	1,294	91,149.36	0.08
403	600549	厦门钨业	5,300	91,054.00	0.08
404	688626	翔宇医疗	1,705	90,859.45	0.08
405	600416	湘电股份	5,700	90,516.00	0.08
406	600399	抚顺特钢	9,200	89,424.00	0.08
407	600739	辽宁成大	7,500	88,350.00	0.08
408	000066	中国长城	8,700	88,044.00	0.08
409	300395	菲利华	2,400	87,744.00	0.08
410	688728	格科微	4,270	87,406.90	0.08
411	688281	华秦科技	644	87,365.04	0.08
412	002739	万达电影	6,700	87,234.00	0.08
413	688080	映翰通	2,135	86,638.30	0.08
414	002444	巨星科技	3,800	85,576.00	0.08
415	300017	网宿科技	10,900	85,565.00	0.08
416	300474	景嘉微	1,200	84,852.00	0.08
417	688120	华海清科	452	84,840.40	0.08
418	001872	招商港口	5,300	84,588.00	0.07
419	301061	匠心家居	1,700	84,575.00	0.07
420	002353	杰瑞股份	3,000	84,330.00	0.07
421	000591	太阳能	15,100	84,258.00	0.07
422	688628	优利德	2,136	84,158.40	0.07
423	688386	泛亚微透	2,052	83,721.60	0.07

424	002756	永兴材料	1,600	83,536.00	0.07
425	300058	蓝色光标	11,600	83,288.00	0.07
426	688052	纳芯微	499	83,258.15	0.07
427	600612	老凤祥	1,200	82,800.00	0.07
428	301257	普蕊斯	1,300	82,550.00	0.07
429	002497	雅化集团	6,300	82,467.00	0.07
430	688511	天微电子	2,615	82,294.05	0.07
431	600516	方大炭素	15,700	82,268.00	0.07
432	002407	多氟多	5,400	82,188.00	0.07
433	002262	恩华药业	3,000	81,360.00	0.07
434	300118	东方日升	4,600	81,190.00	0.07
435	603518	锦泓集团	8,100	81,162.00	0.07
436	601021	春秋航空	1,600	80,320.00	0.07
437	002607	中公教育	19,600	79,968.00	0.07
438	600859	王府井	5,000	79,850.00	0.07
439	300115	长盈精密	6,000	79,500.00	0.07
440	003028	振邦智能	1,800	79,308.00	0.07
441	600667	太极实业	11,170	78,525.10	0.07
442	603000	人民网	2,800	78,344.00	0.07
443	300748	金力永磁	3,860	78,049.20	0.07
444	601216	君正集团	20,800	77,792.00	0.07
445	002195	岩山科技	25,300	77,671.00	0.07
446	000831	中国稀土	2,800	77,476.00	0.07
447	301239	普瑞眼科	900	77,400.00	0.07
448	600004	白云机场	7,900	77,262.00	0.07
449	002368	太极股份	2,600	76,778.00	0.07
450	300860	锋尚文化	1,400	76,482.00	0.07
451	301051	信濠光电	1,200	76,404.00	0.07
452	600435	北方导航	6,500	76,310.00	0.07
453	300577	开润股份	5,200	76,284.00	0.07
454	000893	亚钾国际	2,900	76,096.00	0.07
455	300024	机器人	6,400	75,968.00	0.07
456	002624	完美世界	6,400	75,776.00	0.07
457	603967	中创物流	7,300	75,482.00	0.07
458	002432	九安医疗	2,000	75,340.00	0.07
459	601106	中国一重	26,100	75,168.00	0.07
460	000683	远兴能源	12,800	75,136.00	0.07
461	689009	九号公司	2,522	74,802.52	0.07
462	002131	利欧股份	32,800	74,784.00	0.07
463	000998	隆平高科	5,300	74,730.00	0.07
464	300699	光威复材	2,800	74,676.00	0.07
465	000021	深科技	4,600	74,566.00	0.07
466	688567	孚能科技	4,567	74,487.77	0.07

467	603885	吉祥航空	6,200	74,400.00	0.07
468	600995	南网储能	7,500	73,950.00	0.07
469	000629	钒钛股份	22,500	73,800.00	0.07
470	002926	华西证券	9,500	73,720.00	0.07
471	600118	中国卫星	2,853	73,664.46	0.07
472	601665	齐鲁银行	18,800	73,508.00	0.07
473	600498	烽火通信	4,400	73,216.00	0.06
474	603858	步长制药	4,300	73,143.00	0.06
475	301004	嘉益股份	1,600	72,720.00	0.06
476	601456	国联证券	6,700	72,628.00	0.06
477	002064	华峰化学	10,800	72,468.00	0.06
478	002409	雅克科技	1,300	72,449.00	0.06
479	002558	巨人网络	6,500	72,410.00	0.06
480	000750	国海证券	20,400	72,216.00	0.06
481	300604	长川科技	1,900	72,181.00	0.06
482	688331	荣昌生物	1,158	71,865.48	0.06
483	600258	首旅酒店	4,600	71,852.00	0.06
484	002500	山西证券	13,300	71,687.00	0.06
485	002507	涪陵榨菜	5,000	71,450.00	0.06
486	600863	内蒙华电	18,300	71,370.00	0.06
487	600297	广汇汽车	41,400	71,208.00	0.06
488	002936	郑州银行	35,180	70,711.80	0.06
489	601933	永辉超市	25,000	70,500.00	0.06
490	688310	迈得医疗	2,355	70,414.50	0.06
491	002019	亿帆医药	4,700	69,466.00	0.06
492	001215	千味央厨	1,300	68,653.00	0.06
493	002891	中宠股份	2,600	68,510.00	0.06
494	300856	科思股份	1,100	68,453.00	0.06
495	603883	老百姓	2,290	68,448.10	0.06
496	300390	天华新能	2,700	68,445.00	0.06
497	601778	晶科科技	19,500	68,250.00	0.06
498	002240	盛新锂能	3,000	68,250.00	0.06
499	300383	光环新网	7,000	68,040.00	0.06
500	688538	和辉光电	27,879	67,745.97	0.06
501	300595	欧普康视	3,000	67,740.00	0.06
502	601187	厦门银行	13,300	67,431.00	0.06
503	601992	金隅集团	35,300	67,423.00	0.06
504	688005	容百科技	1,691	67,301.80	0.06
505	300676	华大基因	1,400	67,200.00	0.06
506	002430	杭氧股份	2,300	67,183.00	0.06
507	601607	上海医药	4,000	66,920.00	0.06
508	002832	比音勒芬	2,100	66,570.00	0.06
509	688234	天岳先进	1,006	66,466.42	0.06



510	300870	欧陆通	1,500	66,405.00	0.06
511	300487	蓝晓科技	1,250	66,325.00	0.06
512	300908	仲景食品	1,600	66,032.00	0.06
513	002065	东华软件	10,700	66,019.00	0.06
514	002092	中泰化学	10,800	65,880.00	0.06
515	000709	河钢股份	30,700	65,391.00	0.06
516	603517	绝味食品	2,400	64,464.00	0.06
517	002991	甘源食品	900	64,314.00	0.06
518	600829	人民同泰	8,200	64,124.00	0.06
519	603127	昭衍新药	2,700	64,017.00	0.06
520	300357	我武生物	2,200	63,800.00	0.06
521	600479	千金药业	5,900	63,543.00	0.06
522	600167	联美控股	11,200	63,504.00	0.06
523	600713	南京医药	13,100	63,404.00	0.06
524	000519	中兵红箭	4,500	63,180.00	0.06
525	688063	派能科技	596	63,176.00	0.06
526	600906	财达证券	8,400	63,000.00	0.06
527	603600	永艺股份	5,700	62,928.00	0.06
528	002847	盐津铺子	900	62,532.00	0.06
529	002183	怡亚通	13,900	62,272.00	0.06
530	600316	洪都航空	2,900	61,393.00	0.05
531	000729	燕京啤酒	7,100	61,273.00	0.05
532	002010	传化智联	13,200	60,984.00	0.05
533	002429	兆驰股份	10,900	60,822.00	0.05
534	600329	达仁堂	1,800	60,570.00	0.05
535	300251	光线传媒	7,400	60,310.00	0.05
536	300001	特锐德	3,000	60,300.00	0.05
537	603737	三棵树	1,260	59,988.60	0.05
538	600977	中国电影	4,900	59,976.00	0.05
539	603185	弘元绿能	1,800	59,904.00	0.05
540	600022	山东钢铁	43,700	59,869.00	0.05
541	300026	红日药业	14,100	59,784.00	0.05
542	300212	易华录	1,900	59,755.00	0.05
543	603026	胜华新材	1,300	59,618.00	0.05
544	601211	国泰君安	4,000	59,520.00	0.05
545	000089	深圳机场	9,200	59,156.00	0.05
546	688385	复旦微电	1,531	59,142.53	0.05
547	002568	百润股份	2,400	59,064.00	0.05
548	002511	中顺洁柔	5,900	59,000.00	0.05
549	601138	工业富联	3,900	58,968.00	0.05
550	000155	川能动力	4,400	58,476.00	0.05
551	002268	电科网安	2,600	58,396.00	0.05
552	300253	卫宁健康	8,100	58,239.00	0.05

553	002120	韵达股份	7,800	58,188.00	0.05
554	002670	国盛金控	6,200	57,784.00	0.05
555	600332	白云山	2,000	57,200.00	0.05
556	002326	永太科技	4,900	56,938.00	0.05
557	300114	中航电测	1,300	56,875.00	0.05
558	002462	嘉事堂	4,000	56,840.00	0.05
559	605166	聚合顺	5,700	56,544.00	0.05
560	601991	大唐发电	23,300	56,386.00	0.05
561	600869	远东股份	12,600	55,314.00	0.05
562	300373	扬杰科技	1,500	55,050.00	0.05
563	603368	柳药集团	2,900	54,868.00	0.05
564	600378	昊华科技	1,800	54,864.00	0.05
565	601678	滨化股份	13,000	54,730.00	0.05
566	600761	安徽合力	3,000	54,630.00	0.05
567	002865	钧达股份	700	54,236.00	0.05
568	688032	禾迈股份	200	54,000.00	0.05
569	002788	鹭燕医药	6,000	53,940.00	0.05
570	000401	冀东水泥	8,400	53,676.00	0.05
571	600729	重庆百货	1,900	53,580.00	0.05
572	603826	坤彩科技	900	53,127.00	0.05
573	603822	嘉澳环保	1,900	52,839.00	0.05
574	600438	通威股份	2,100	52,563.00	0.05
575	688599	天合光能	1,841	52,523.73	0.05
576	601318	中国平安	1,300	52,390.00	0.05
577	002531	天顺风能	4,500	52,200.00	0.05
578	600966	博汇纸业	8,400	52,164.00	0.05
579	300070	碧水源	10,400	51,896.00	0.05
580	600210	紫江企业	11,000	51,700.00	0.05
581	600742	一汽富维	5,400	51,570.00	0.05
582	000825	太钢不锈	13,800	51,474.00	0.05
583	000950	重药控股	10,300	51,191.00	0.05
584	002048	宁波华翔	3,900	50,739.00	0.04
585	300363	博腾股份	2,000	50,300.00	0.04
586	002683	广东宏大	2,500	50,200.00	0.04
587	002155	湖南黄金	4,500	50,130.00	0.04
588	002508	老板电器	2,300	50,094.00	0.04
589	601601	中国太保	2,100	49,938.00	0.04
590	600866	星湖科技	10,700	49,862.00	0.04
591	000028	国药一致	1,700	49,283.00	0.04
592	002192	融捷股份	900	48,789.00	0.04
593	300393	中来股份	4,700	48,598.00	0.04
594	002281	光迅科技	1,700	48,450.00	0.04
595	300438	鹏辉能源	1,700	48,093.00	0.04

596	002487	大金重工	1,800	47,916.00	0.04
597	000528	柳工	7,100	47,854.00	0.04
598	002649	博彦科技	3,900	47,853.00	0.04
599	002274	华昌化工	6,300	47,565.00	0.04
600	002539	云图控股	5,600	46,200.00	0.04
601	688568	中科星图	937	45,969.22	0.04
602	000589	贵州轮胎	7,500	45,900.00	0.04
603	688082	盛美上海	439	45,835.99	0.04
604	000544	中原环保	6,500	45,110.00	0.04
605	002153	石基信息	4,600	44,804.00	0.04
606	003035	南网能源	8,400	44,184.00	0.04
607	000404	长虹华意	7,500	44,175.00	0.04
608	000719	中原传媒	4,500	43,785.00	0.04
609	000059	华锦股份	7,900	43,371.00	0.04
610	000521	长虹美菱	7,700	43,351.00	0.04
611	002573	清新环境	8,700	43,065.00	0.04
612	002768	国恩股份	2,000	42,840.00	0.04
613	003022	联泓新科	2,300	42,113.00	0.04
614	600126	杭钢股份	7,800	41,574.00	0.04
615	300772	运达股份	3,900	41,496.00	0.04
616	000049	德赛电池	1,520	41,222.40	0.04
617	002918	蒙娜丽莎	3,000	40,620.00	0.04
618	002913	奥士康	1,300	39,845.00	0.04
619	603730	岱美股份	2,700	39,123.00	0.03
620	688011	新光光电	1,653	39,093.45	0.03
621	000034	神州数码	1,300	38,883.00	0.03
622	600489	中金黄金	3,900	38,844.00	0.03
623	002518	科士达	1,200	33,120.00	0.03
624	301043	绿岛风	1,000	32,730.00	0.03
625	600968	海油发展	10,100	28,785.00	0.03
626	603612	索通发展	700	10,773.00	0.01
627	600710	苏美达	600	4,254.00	0.00
628	688777	中控技术	86	3,900.10	0.00
629	600325	华发股份	400	2,884.00	0.00
630	002244	滨江集团	300	2,181.00	0.00
631	001914	招商积余	100	1,196.00	0.00
632	000062	深圳华强	100	1,127.00	0.00
633	600848	上海临港	100	1,005.00	0.00
634	600663	陆家嘴	100	875.00	0.00
635	000402	金融街	200	726.00	0.00
636	600064	南京高科	100	604.00	0.00
637	000031	大悦城	200	594.00	0.00
638	600208	新湖中宝	200	434.00	0.00

639	002133	广宇集团	100	349.00	0.00
-----	--------	------	-----	--------	------

### 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

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	688627	精智达	70	6,140.40	0.01
2	688582	芯动联科	130	5,027.10	0.00
3	688563	航材股份	79	4,778.71	0.00
4	688603	天承科技	60	4,448.40	0.00
5	688631	莱斯信息	104	3,666.00	0.00
6	603273	天元智能	117	2,219.49	0.00
7	603107	上海汽配	72	1,309.68	0.00
8	603193	润本股份	70	1,166.20	0.00

## 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	002056	横店东磁	4,192,328.00	3.38
2	300308	中际旭创	3,916,658.00	3.15
3	002244	滨江集团	3,356,443.00	2.70
4	002422	科伦药业	3,348,122.06	2.70
5	000513	丽珠集团	3,314,859.00	2.67
6	002625	光启技术	2,808,802.20	2.26
7	300146	汤臣倍健	2,758,087.00	2.22
8	300724	捷佳伟创	2,752,315.00	2.22
9	300003	乐普医疗	2,717,860.00	2.19
10	002384	东山精密	2,683,343.00	2.16
11	002831	裕同科技	2,660,306.00	2.14
12	300009	安科生物	2,650,678.00	2.13
13	002128	电投能源	2,648,620.00	2.13
14	000997	新大陆	2,637,630.00	2.12
15	000012	南玻 A	2,635,000.00	2.12
16	300866	安克创新	2,626,130.13	2.12
17	000999	华润三九	2,588,580.00	2.08
18	002372	伟星新材	2,552,484.00	2.06
19	300888	稳健医疗	2,538,500.80	2.04
20	300832	新产业	2,534,884.00	2.04
21	000932	华菱钢铁	2,529,204.00	2.04

22	002138	顺络电子	2,516,401.00	2.03
23	000728	国元证券	2,509,421.00	2.02

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	300308	中际旭创	4,456,432.00	3.59
2	002422	科伦药业	3,985,344.00	3.21
3	002244	滨江集团	3,768,473.00	3.04
4	002056	横店东磁	3,391,510.00	2.73
5	000513	丽珠集团	3,353,648.00	2.70
6	002384	东山精密	3,309,240.00	2.67
7	000999	华润三九	3,094,755.00	2.49
8	000932	华菱钢铁	3,069,222.00	2.47
9	300136	信维通信	3,011,033.00	2.43
10	300724	捷佳伟创	2,990,191.00	2.41
11	300866	安克创新	2,913,322.93	2.35
12	002595	豪迈科技	2,881,106.00	2.32
13	601699	潞安环能	2,857,657.00	2.30
14	000997	新大陆	2,840,166.00	2.29
15	002831	裕同科技	2,838,779.00	2.29
16	002372	伟星新材	2,837,480.69	2.29
17	000598	兴蓉环境	2,819,886.00	2.27
18	603444	吉比特	2,750,447.00	2.22
19	300003	乐普医疗	2,739,266.00	2.21
20	002273	水晶光电	2,714,181.00	2.19
21	300861	美畅股份	2,679,467.86	2.16
22	000012	南玻 A	2,673,732.00	2.15
23	002625	光启技术	2,638,360.00	2.13
24	002128	电投能源	2,637,839.00	2.12
25	300888	稳健医疗	2,611,986.55	2.10
26	300073	当升科技	2,599,263.00	2.09
27	300390	天华新能	2,563,744.26	2.06
28	300363	博腾股份	2,537,999.00	2.04
29	300146	汤臣倍健	2,535,874.00	2.04
30	002867	周大生	2,505,727.00	2.02
31	000027	深圳能源	2,494,856.00	2.01

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	707,619,360.20
卖出股票收入（成交）总额	701,514,281.93

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）	2,700.20	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,700.20	0.00

### 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	127100	神码转债	27	2,700.20	0.00

### 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

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

## 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。

### 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	418,301.74
2	应收清算款	248,657.57
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	666,959.31

#### 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

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	688627	精智达	6,140.40	0.01	新股锁定期
2	688582	芯动联科	5,027.10	0.00	新股锁定期
3	688563	航材股份	4,778.71	0.00	新股锁定期
4	688603	天承科技	4,448.40	0.00	新股锁定期

## § 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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,903	68,355.40	42,692,033.00	32.82%	87,388,300.00	67.18%

### 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	中信证券股份有限公司	7,616,633.00	5.86%
2	东方证券股份有限公司	7,431,400.00	5.71%
3	广发证券股份有限公司	5,523,000.00	4.25%
4	方正证券股份有限公司	5,288,600.00	4.07%
5	中信建投证券股份有限公司	4,927,400.00	3.79%
6	广东华兴玻璃股份有限公司	3,100,000.00	2.38%
7	马晓霞	2,730,900.00	2.10%
8	杜爱明	2,473,000.00	1.90%
9	杭州波粒二象资产管理有限公司-杭州波粒二象鹏展 1 号私募证券投资基金	2,000,000.00	1.54%



10	高瓴	1,825,000.00	1.40%
----	----	--------------	-------

### 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(2022年1月26日)基金份额总额	746,580,333.00
本报告期期初基金份额总额	137,580,333.00
本报告期基金总申购份额	292,500,000.00
减：报告期基金总赎回份额	300,000,000.00
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	130,080,333.00

## § 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未发生重大人事变动。

### 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 2 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 25,000.00 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	
华泰证券	2	648,483,424.27	46.07%	64,843.96	46.07%	-
兴业证券	1	508,872,555.96	36.16%	50,899.11	36.16%	-
海通证券	1	246,927,672.45	17.54%	24,697.90	17.55%	-
中信建投	1	3,174,996.60	0.23%	317.53	0.23%	-
广发证券	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

### 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
华泰证券	124,728.15	65.03%	-	-	-	-
兴业证券	15,665.89	8.17%	-	-	-	-
海通证券	15,216.19	7.93%	-	-	-	-
中信建投	36,200.40	18.87%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

### 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	南方基金关于旗下部分基金增加长城证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-14
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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-18
3	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会	2023-03-22

		基金电子披露网站	
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-22
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
6	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-07
7	南方基金关于旗下部分基金增加万联证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-07
8	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-15
9	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-26
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-29
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-10
12	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-30
13	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21
14	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-11
15	南方基金关于旗下部分基金增加东方证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-08
16	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-21
17	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-09-07
18	南方基金管理股份有限公司关于终止南京途牛	证券日报、基金管理	2023-09-07

	基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	人网站、中国证监会基金电子披露网站	
19	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-03
20	南方基金关于旗下部分基金增加浙商证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-16
21	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-04
22	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-15
23	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-23

## § 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

## § 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南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证 500 增强策略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>