

南方恒生交易型开放式指数证券投资 基金 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	5
2.5 信息披露方式	5
2.6 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	35
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	35
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细	36
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	45
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	48
7.8 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	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	48

7.10 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方恒生交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方恒生指数 ETF
场内简称	恒指 ETF（恒生指数 ETF）
基金主代码	513600
交易代码	513600
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 月 23 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	266,829,500.00 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	2015 年 1 月 26 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金为被动式指数基金，采用指数复制法。本基金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，在保持基金资产的流动性前提下，达到有效复制标的指数的目的。</p> <p>本基金采用的主要投资步骤及策略包括：（1）股票投资组合的构建、（2）股票投资组合的调整、（3）存托凭证的投资策略、（4）债券和货币市场工具的配置策略、（5）金融衍生产品投资策略。</p>
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数（使用估值汇率调整），本基金标的指数为恒生指数。
风险收益特征	本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资香港证券市场上市的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.
		郭明
		010-66105799
		custody@icbc.com.cn

		com	
客户服务电话	400-889-8899	95588	
传真	0755-82763889	010-66105798	
注册地址	深圳市福田区莲花街道 益田路 5999 号基金大 厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
办公地址	深圳市福田区莲花街道 益田路 5999 号基金大 厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
邮政编码	518017	100140	
法定代表人	周易	陈四清	

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

无

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	17,347,096.35
本期利润	6,684,515.57
加权平均基金份额本期利润	0.0236
本期加权平均净值利润率	1.10%
本期基金份额净值增长率	-0.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	52,321,297.32
期末可供分配基金份额利润	0.1960
期末基金资产净值	566,798,415.91
期末基金份额净值	2.1242
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	10.17%

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

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

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

3.2 基金净值表现

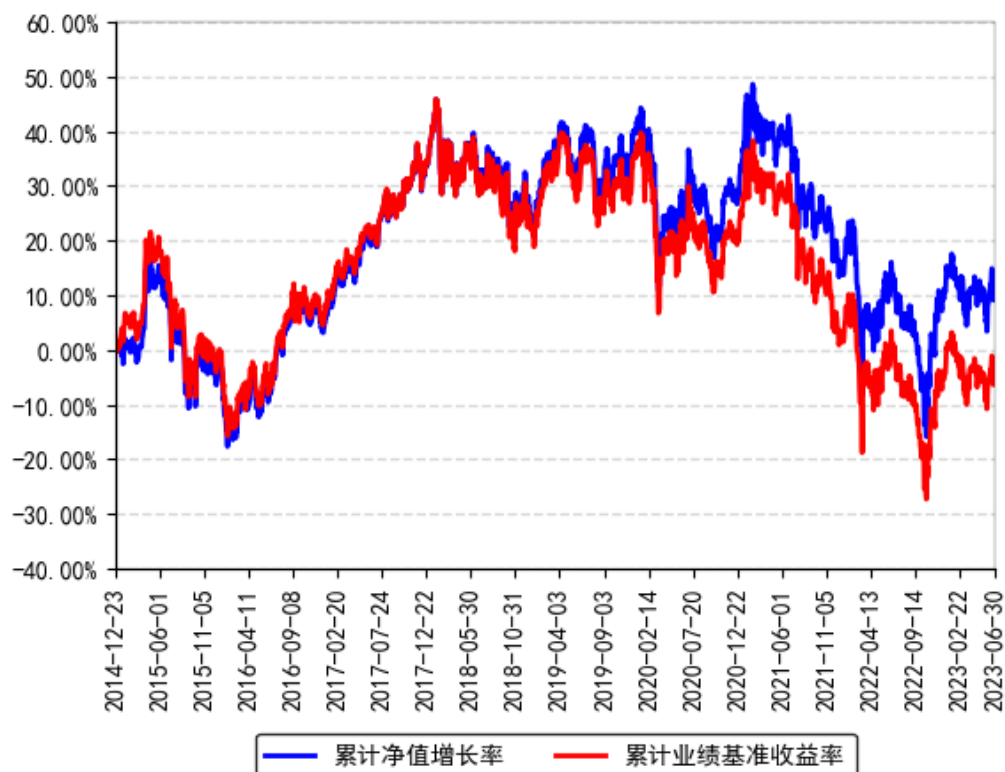
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.58%	1.32%	5.84%	1.37%	0.74%	-0.05%
过去三个月	-0.64%	1.20%	-2.34%	1.20%	1.70%	0.00%
过去六个月	-0.35%	1.28%	-1.30%	1.33%	0.95%	-0.05%
过去一年	-3.21%	1.57%	-6.71%	1.63%	3.50%	-0.06%
过去三年	-12.89%	1.46%	-21.84%	1.52%	8.95%	-0.06%

自基金合同生效起至今	10.17%	1.29%	-5.62%	1.34%	15.79%	-0.05%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

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

南方恒生指数ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

					中证香港科技 ETF (QDII) 基金经理； 2022 年 6 月 17 日至今，任南方恒生香港上市生物科技 ETF (QDII) 基金经理； 2023 年 5 月 30 日至今，任南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接 (QDII) 基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.4.2 异常交易行为的专项说明

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

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，恒生指数下跌 4.37%。期间我们通过自建的指数化交易系统、日内择时交易模型、跟踪误差归因分析系统、ETF 现金流精算系统等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

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

(2) 港股通的交易风控资金的安排，导致基金实际仓位和基准的偏离。

4.5.2 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 2.1242 元，报告期内，份额净值增长率为-0.35%，同期业绩基准增长率为-1.30%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

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

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

本报告期内,本基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方恒生交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	17,050,425.16	8,610,547.90
结算备付金		1,440,923.47	30,542.23
存出保证金		8,320.30	-
交易性金融资产	6.4.3.2	560,749,734.16	732,437,432.60
其中：股票投资		560,749,734.16	732,437,432.60
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	4,708,954.86
应收股利		3,008,444.03	40,128.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		582,257,847.12	745,827,605.59
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月

		日	31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,524,464.98	6,925.14
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		241,599.94	315,492.76
应付托管费		48,319.99	63,098.55
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	6.4.3.6	11,645,046.30	6,122,652.87
负债合计		15,459,431.21	6,508,169.32
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	514,477,118.59	668,726,064.85
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	52,321,297.32	70,593,371.42
净资产合计		566,798,415.91	739,319,436.27
负债和净资产总计		582,257,847.12	745,827,605.59

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.1242 元，基金份额总额 266,829,500.00 份。

6.2 利润表

会计主体：南方恒生交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		8,814,086.48	3,965,181.22
1.利息收入		37,714.82	37,421.93
其中：存款利息收入	6.4.3.9	37,714.82	37,421.93
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,021,297.01	-4,655,235.35
其中：股票投资收益	6.4.3.10	5,575,055.32	-14,336,987.97
基金投资收益	6.4.3.11	-	-
债券投资收益	6.4.3.12	-	-
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.13	-	-
股利收益	6.4.3.14	13,446,241.69	9,681,752.62
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.3.15	-10,662,580.78	7,947,581.08
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.3.16	417,655.43	635,413.56
减：二、营业总支出		2,129,570.91	1,757,311.80
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	1,512,798.97	1,291,006.64
2.托管费	6.4.6.2.2	302,559.80	258,201.30
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.3.17	314,212.14	208,103.86
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		6,684,515.57	2,207,869.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		6,684,515.57	2,207,869.42
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		6,684,515.57	2,207,869.42

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方恒生交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	668,726,064.85	-	70,593,371.42	739,319,436.27
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	668,726,064.85	-	70,593,371.42	739,319,436.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-154,248,946.26	-	-18,272,074.10	-172,521,020.36
(一)、综合收益总额	-	-	6,684,515.57	6,684,515.57
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-154,248,946.26	-	-24,956,589.67	-179,205,535.93
其中：1.基金申购款	104,118,038.99	-	9,230,205.80	113,348,244.79
2.基金赎回款	-258,366,985.25	-	-34,186,795.47	-292,553,780.72
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	514,477,118.59	-	52,321,297.32	566,798,415.91
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	381,437,400.43	-	61,788,284.19	443,225,684.62

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	381,437,400.43	-	61,788,284.19	443,225,684.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	127,255,380.95	-	8,556,977.86	135,812,358.81
(一)、综合收益总额	-	-	2,207,869.42	2,207,869.42
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	127,255,380.95	-	6,349,108.44	133,604,489.39
其中：1.基金申购款	264,151,321.21	-	16,648,899.46	280,800,220.67
2.基金赎回款	-136,895,940.26	-	-10,299,791.02	-147,195,731.28
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	508,692,781.38	-	70,345,262.05	579,038,043.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	17,050,425.16
等于：本金	17,049,637.39
加：应计利息	787.77
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	17,050,425.16

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	576,917,098.65	-	560,749,734.16	-16,167,364.49
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	576,917,098.65	-	560,749,734.16	-16,167,364.49	

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	12,136.04
其中：交易所市场	12,136.04
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	11,417,666.71
预提费用	94,219.55
应付指数使用费	121,024.00
可退替代款	-
其他	-
合计	11,645,046.30

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

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	346,829,500.00	668,726,064.85
本期申购	54,000,000.00	104,118,038.99
本期赎回 (以“-”号填列)	-134,000,000.00	-258,366,985.25
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	266,829,500.00	514,477,118.59

6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	132,198,629.00	-61,605,257.58	70,593,371.42
本期利润	17,347,096.35	-10,662,580.78	6,684,515.57
本期基金份额交易产生的变动数	-32,511,726.26	7,555,136.59	-24,956,589.67
其中：基金申购款	22,318,145.36	-13,087,939.56	9,230,205.80
基金赎回款	-54,829,871.62	20,643,076.15	-34,186,795.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,033,999.09	-64,712,701.77	52,321,297.32

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	18,688.03
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	18,945.82
其他	80.97
合计	37,714.82

6.4.3.10 股票投资收益

6.4.3.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,575,055.32
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	5,575,055.32

6.4.3.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	303,980,142.79
减：卖出股票成本总额	297,735,844.84
减：交易费用	669,242.63
买卖股票差价收入	5,575,055.32

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	292,553,780.72
减：现金支付赎回款总额	292,553,780.72
减：赎回股票成本总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.3.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.3.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.3.11 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.3.12 债券投资收益**6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.3.13 衍生工具收益**6.4.3.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.3.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.3.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	13,446,241.69
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	13,446,241.69

6.4.3.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-10,662,580.78
——股票投资	-10,662,580.78
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-10,662,580.78

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

6.4.3.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	417,655.43
合计	417,655.43

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

6.4.3.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
指数使用费	195,525.74
银行费用	269.00
其他	24,197.85
合计	314,212.14

指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.04% 的年费率计提，逐日累计，按季支付标的指数许可使用费的收取下限为每季度港币 25,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	基金管理人
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
南方恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金("南方恒生 ETF 联接基金")	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	120,799,842.88	27.75%	395,428,060.52	100.00%

6.4.6.1.2 基金交易

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基金交易。

6.4.6.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	12,080.03	27.75%	5,981.15	49.28%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	39,542.77	100.00%	13,234.79	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。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,512,798.97	1,291,006.64
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	302,559.80	258,201.30

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

6.4.6.2.3 销售服务费

无。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	570,098.00	0.21%	550,000.00	0.16%
南方恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金	99,077,776.00	37.13%	101,474,576.00	29.26%

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

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	17,050,425.16	18,688.03	3,627,586.75	22,804.97

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

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

于本期末，本基金持有关联方工商银行发行的普通股，成本总额为人民币 14,835,822.27 元，估值总额为人民币 15,373,112.96 元，占本基金基金资产净值的比例为 2.71%（上年度末，本基金持有关联方工商银行发行的普通股，成本总额为人民币 18,920,233.09 元，估值总额为人民币 18,234,820.74 元，占本基金基金资产净值的比例为 2.47%）。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资香港证券市场上市的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金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，在保持基金资产的流动性前提下，达到有效复制标的指数的目的，本基金力争将年化跟踪误差最小化。本基金优先通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股，如果未来出现由于港股通额度受限、业务规则发生重大变更等影响投资运作的情形时，为了更好的保护投资人的利益，实现投资目标，本基金将可以直接委托香港的经纪商投资标的指数的成份股、备选成份股。

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

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

6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务

为通过该方式向证券公司出借证券,本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理,对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整,且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.9.3 流动性风险

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

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,050,425.16	-	-	-	17,050,425.16
结算备付金	1,440,923.47	-	-	-	1,440,923.47
存出保证金	8,320.30	-	-	-	8,320.30
交易性金融资产	-	-	-	560,749,734.16	560,749,734.16
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	-	-	-	3,008,444.03	3,008,444.03
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	18,499,668.9	-	-	563,758,178.	582,257,847.

		3			19	12
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		-	-	-	3,524,464.98	3,524,464.98
应付赎回款		-	-	-	-	-
应付管理人 报酬		-	-	-	241,599.94	241,599.94
应付托管费		-	-	-	48,319.99	48,319.99
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		-	-	-	11,645,046.3 0	11,645,046.3 0
负债总计		-	-	-	15,459,431.2 1	15,459,431.2 1
利率敏感度 缺口	18,499,668.9 3		-	-	548,298,746. 98	566,798,415. 91
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计	
资产						
银行存款	8,610,547.90		-	-	-	8,610,547.90
结算备付金	30,542.23		-	-	-	30,542.23
存出保证金	-		-	-	-	-
交易性金融 资产	-		-	-	732,437,432. 60	732,437,432. 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	-	-	-	4,708,954.86	4,708,954.86
应收股利	-	-	-	40,128.00	40,128.00
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,641,090.13	-	-	737,186,515. 46	745,827,605. 59
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	-	-	-	6,925.14	6,925.14
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	315,492.76	315,492.76
应付托管费	-	-	-	63,098.55	63,098.55
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	-	-	-	6,122,652.87	6,122,652.87
负债总计	-	-	-	6,508,169.32	6,508,169.32
利率敏感度 缺口	8,641,090.13	-	-	730,678,346. 14	739,319,436. 27

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	本期末(2023 年 6 月 30 日)	上年度末(2022 年 12 月 31 日)
1. 市场利率平行上升 25 个基点	0.00	0.00
2. 市场利率平行下降 25 个基点	0.00	0.00

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日					合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	560,749,734.16	-	-	-	560,749,734.16
资产合计	-	560,749,734.16	-	-	-	560,749,734.16
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	560,749,734.16	-	-	-	560,749,734.16

项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日					合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	732,437,432.60	-	-	-	732,437,432.60
资产合计	-	732,437,432.60	-	-	-	732,437,432.60
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	732,437,432.60	-	-	-	732,437,432.60

6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	28,037,486.71	36,621,871.63
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-28,037,486.71	-36,621,871.63	

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法，跟踪恒生指数，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，恒生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 80%，公募基金、依法发行上市的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、股指期货等金融衍生品的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	560,749,734.16	98.93	732,437,432.60	99.07
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	560,749,734.16	98.93	732,437,432.60	99.07

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变
----	----------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	26,274,571.87	34,010,112.12
	2.组合自身基准下降 5%	-26,274,571.87	-34,010,112.12

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	560,749,734.16
第二层次	-
第三层次	-
合计	560,749,734.16

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	560,749,734.16	96.31
	其中：普通股	560,749,734.16	96.31
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付 金合计	18,491,348.63	3.18
8	其他资产	3,016,764.33	0.52
9	合计	582,257,847.12	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项中不含可退替代款估值增值；2、本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股市值为人民币 560,749,734.16 元，占基金资产净值比例 98.93%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	560,749,734.16	98.93
合计	560,749,734.16	98.93

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	22,280,236.76	3.93
材料	9,356,110.13	1.65

工业	12,078,744.73	2.13
非必需消费品	45,573,508.46	8.04
必需消费品	29,638,343.95	5.23
医疗保健	12,885,600.22	2.27
金融	206,973,100.50	36.52
科技	19,339,044.96	3.41
通讯	150,616,091.09	26.57
公用事业	18,296,611.28	3.23
房地产	32,473,975.42	5.73
政府	-	-
合计	559,511,367.50	98.71

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
科技	-	-
通讯	1,238,366.66	0.22
公用事业	-	-
房地产	-	-
政府	-	-
合计	1,238,366.66	0.22

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1.1 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权益投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holding s Ltd	腾讯控股有限公司	0700 HK	中国香港联合交易所	中国香港	217,100	66,373,672.11	11.71
2	Meituan	美团	3690	中国香	中国香	559,350	63,071,	11.13

			HK	港联合交易所	港		273.44	
3	HSBC Holding s plc	汇丰控股有限公司	0005 HK	中国香港联合交易所	中国香港	852,000	47,917,144.56	8.45
4	AIA Group Limited	友邦保险控股有限公司	1299 HK	中国香港联合交易所	中国香港	631,600	46,061,715.13	8.13
5	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	0939 HK	中国香港联合交易所	中国香港	5,850,000	27,345,465.81	4.82
6	China Mobile Limited	中国移动有限公司	0941 HK	中国香港联合交易所	中国香港	331,500	19,576,009.50	3.45
7	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	香港交易及结算有限公司	0388 HK	中国香港联合交易所	中国香港	64,900	17,663,735.39	3.12
8	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	中国香港联合交易所	中国香港	342,500	15,741,540.78	2.78
9	Industrial and Commercial Bank of China Limited	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	中国香港联合交易所	中国香港	3,989,000	15,373,112.96	2.71
10	Bank of China Limited	中国银行股份有限公司	3988 HK	中国香港联合交易所	中国香港	4,521,000	13,088,372.76	2.31
11	Byd	比亚迪	1211	中国香	中国香	52,500	12,100,	2.13

	Company Limited	股份有限公司	HK	港联合交易所	港		987.50	
12	Xiaomi Corporation	小米集团	1810 HK	中国香港联合交易所	中国香港	943,400	9,324,212.39	1.65
13	Cnooc Limited	中国海洋石油有限公司	0883 HK	中国香港联合交易所	中国香港	844,000	8,715,292.54	1.54
14	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	药明生物技术有限公司	2269 HK	中国香港联合交易所	中国香港	206,000	7,131,791.89	1.26
15	Sun Hung Kai Properties Ltd.	新鸿基地产发展有限公司	0016 HK	中国香港联合交易所	中国香港	77,500	7,052,455.52	1.24
16	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行股份有限公司	3968 HK	中国香港联合交易所	中国香港	209,500	6,876,311.24	1.21
17	Techtron Industries Co. Ltd.	创科实业有限公司	0669 HK	中国香港联合交易所	中国香港	84,000	6,594,554.15	1.16
18	CK Hutchison Holdings Limited	长江和记实业有限公司	0001 HK	中国香港联合交易所	中国香港	143,776	6,342,928.84	1.12
19	CLP Holdings Ltd.	中电控股有限公司	0002 HK	中国香港联合交易所	中国香港	108,000	6,064,046.86	1.07
20	Petrochina Company	中国石油天然气股份有限公司	0857 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,134,000	5,666,747.23	1.00

	Limited	司						
21	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	0386 HK	中国香港联合交易所	中国香港	1,334,000	5,645,338.86	1.00
22	Galaxy Entertainment Group Limited	银河娱乐集团有限公司	0027 HK	中国香港联合交易所	中国香港	118,000	5,407,043.91	0.95
23	ANTA Sports Products Limited	安踏体育用品有限公司	2020 HK	中国香港联合交易所	中国香港	73,000	5,387,728.43	0.95
24	China Resources Land Limited	华润置地有限公司	1109 HK	中国香港联合交易所	中国香港	170,000	5,203,655.12	0.92
25	Li Ning Co. Ltd.	李宁有限公司	2331 HK	中国香港联合交易所	中国香港	127,000	4,935,405.04	0.87
26	China Life Insurance Company Limited	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	中国香港联合交易所	中国香港	400,000	4,816,423.52	0.85
27	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	中国蒙牛乳业股份有限公司	2319 HK	中国香港联合交易所	中国香港	170,000	4,623,729.70	0.82
28	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	中银香港(控股)有限公司	2388 HK	中国香港联合交易所	中国香港	200,000	4,416,284.20	0.78
29	Nongfu Spring	农夫山泉股份	9633 HK	中国香港联合	中国香港	109,000	4,346,444.22	0.77

	Co., Ltd.	有限公司		交易所				
30	Hang Seng Bank Ltd.	恒生银行有限公司	0011 HK	中国香港联合交易所	中国香港	41,600	4,276,512.03	0.75
31	CK Asset Holdings Limited	长江实业集团有限公司	1113 HK	中国香港联合交易所	中国香港	106,276	4,252,520.64	0.75
32	Semiconductor Manufacturing International Corporation	中芯国际集成电路制造有限公司	0981 HK	中国香港联合交易所	中国香港	226,000	4,250,696.59	0.75
33	China Resources Beer (Holdings) Company Limited	华润啤酒(控股)有限公司	0291 HK	中国香港联合交易所	中国香港	88,000	4,186,526.78	0.74
34	China Shenhua Energy Company Limited	中国神华能源股份有限公司	1088 HK	中国香港联合交易所	中国香港	183,500	4,051,940.75	0.71
35	ENN Energy Holdings Limited	新奥能源控股有限公司	2688 HK	中国香港联合交易所	中国香港	42,800	3,851,368.61	0.68
36	The Hong Kong and China Gas Co.	香港中华煤气有限公司	0003 HK	中国香港联合交易所	中国香港	605,625	3,780,192.91	0.67

	Ltd.							
37	Sands China Ltd.	金沙中国有限公司	1928 HK	中国香港联合交易所	中国香港	153,200	3,771,303.87	0.67
38	CITIC Limited	中国中信股份有限公司	0267 HK	中国香港联合交易所	中国香港	394,000	3,396,482.12	0.60
39	MTR Corporation Ltd.	香港铁路有限公司	0066 HK	中国香港联合交易所	中国香港	101,000	3,352,319.28	0.59
40	China Overseas Land & Investment Ltd.	中国海外发展有限公司	0688 HK	中国香港联合交易所	中国香港	208,000	3,275,463.03	0.58
41	Wharf Real Estate Investment Company Limited	九龙仓置业地产投资有限公司	1997 HK	中国香港联合交易所	中国香港	90,000	3,248,596.53	0.57
42	Zijin Mining Group Company Limited	紫金矿业集团股份有限公司	2899 HK	中国香港联合交易所	中国香港	296,000	3,138,419.92	0.55
43	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	申洲国际集团控股有限公司	2313 HK	中国香港联合交易所	中国香港	44,800	3,087,526.62	0.54
44	CSPC Pharmaceutical Group Limited	石药集团有限公司	1093 HK	中国香港联合交易所	中国香港	484,640	3,042,901.32	0.54
45	Haier	海尔智	6690	中国香	中国香	131,800	2,995,3	0.53

	Smart Home Co., Ltd.	家股份有限公司	HK	港联合交易所	港		93.16	
46	Lenovo Group Limited	联想集团有限公司	0992 HK	中国香港联合交易所	中国香港	396,000	2,982,900.33	0.53
47	Geely Automobile Holdings Limited	吉利汽车控股有限公司	0175 HK	中国香港联合交易所	中国香港	327,000	2,882,220.12	0.51
48	Power Assets Holdings Limited	电能实业有限公司	0006 HK	中国香港联合交易所	中国香港	75,000	2,838,545.93	0.50
49	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	舜宇光学科技(集团)有限公司	2382 HK	中国香港联合交易所	中国香港	38,600	2,781,235.65	0.49
50	Jd Health International Inc.	京东健康股份有限公司	6618 HK	中国香港联合交易所	中国香港	60,100	2,740,073.85	0.48
51	Xinyi Solar Holdings Limited	信义光能控股有限公司	0968 HK	中国香港联合交易所	中国香港	270,000	2,252,858.13	0.40
52	Budweiser Brewing Company APAC Limited	百威亚太控股有限公司	1876 HK	中国香港联合交易所	中国香港	107,300	1,998,354.77	0.35
53	Sino Biophar	中国生物制药	1177 HK	中国香港联合交易所	中国香港	611,000	1,920,954.55	0.34

	maceuti cal Limited	有限公 司		交易所				
54	Longfor Group Holdings Limited	龙湖集 团控股 有限公司	0960 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	104,000	1,825,6 67.92	0.32
55	China Resourc es Power Holdings Co. Ltd.	华润电 力控股 有限公司	0836 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	108,000	1,762,4 56.97	0.31
56	WH Group Limited	万洲国 际有限 公司	0288 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	451,000	1,725,6 23.87	0.30
57	Henders on Land Develop ment Co. Ltd.	恒基兆 业地产 有限公司	0012 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	79,487	1,707,5 50.39	0.30
58	Haidilao Internati onal Holding Ltd.	海底捞 国际控 股有限 公司	6862 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	106,000	1,684,8 63.13	0.30
59	China Unicom (Hong Kong) Limited	中国联 合网络 通信(香 港)股份 有限公司	0762 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	334,000	1,595,1 36.04	0.28
60	Chow Tai Fook Jeweller y Group Limited	周大福 珠宝集 团有限 公司	1929 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	108,400	1,407,1 92.26	0.25
61	CK Infrastru cture Holding	长江基 建集团 有限公司	1038 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	35,500	1,356,6 70.52	0.24

	s Limited							
62	New World Develop ment Co. Ltd.	新世界 发展有 限公司	0017 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	75,750	1,346,5 14.91	0.24
63	China Resourc es Mixc Lifestyl e Services Limited	华润万 象生活 有限公 司	1209 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	37,200	1,334,1 78.82	0.24
64	Alibaba Health Informa tion Technol ogy Limited	阿里健 康信息 技术有 限公司	0241 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	292,000	1,268,0 17.53	0.22
65	XinYi Glass Holdings Limited	信义玻 璃控股 有限公 司	0868 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	112,000	1,259,7 93.47	0.22
66	Tingyi (Cayma n Islands) Holdings Corp.	康师傅 控股有 限公司	0322 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	110,000	1,235,2 68.80	0.22
67	Hengan Internati onal Group Compan y Limited	恒安国 际集团 有限公 司	1044 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	38,500	1,171,3 75.59	0.21
68	Country Garden Services Holdings	碧桂园 服务控 股有限 公司	6098 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	120,000	1,119,6 52.51	0.20

	Compan y Limited							
69	Hang Lung Properti es Ltd.	恒隆地 产有限 公司	0101 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	98,000	1,093,2 83.88	0.19
70	Zhongs heng Group Holdin g s Ltd	中升集 团控股 有限公 司	0881 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	39,500	1,090,7 25.39	0.19
71	Country Garden Holdin g s Co. Ltd	碧桂园 控股有 限公司	2007 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	692,000	1,014,4 36.15	0.18
72	China Hongqia o Group Limited	中国宏 桥集团 有限公 司	1378 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	154,500	905,955 .99	0.16
73	JD.Com , Inc.	京东集 团股份 有限公 司	9618 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	6,743	823,119 .03	0.15
74	Hansoh Pharma ceutical Group Compan y Limited	翰森制 药集团 有限公 司	3692 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	68,000	789,952 .46	0.14
75	Orient Oversea s (Internat ional) Ltd.	东方海 外(国际) 有限公 司	0316 HK	中国香 港联合 交易所	中国香 港	8,000	775,200 .78	0.14

7.4.1.2 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权益投资明细

序号	公司名 称(英 文)	公司名 称(中 文)	证券代 码	所在证 券市场	所属国 家(地 区)	数量 (股)	公允价 值(人 民币元)	占基金 资产净 值比例
----	------------------	------------------	----------	------------	------------------	-----------	--------------------	-------------------

								(%)
1	Tongcheng Travel Holdings Limited	同程旅行控股有限公司	0780 HK	中国香港联合交易所	中国香港	82,000	1,238,366.66	0.22

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	Meituan	3690 HK	20,795,219.43	2.81
2	Tencent Holdings Ltd	700 HK	11,765,711.96	1.59
3	HSBC Holdings plc	5 HK	8,993,895.88	1.22
4	AIA Group Limited	1299 HK	8,607,451.62	1.16
5	China Construction Bank Corporation	939 HK	5,653,669.89	0.76
6	Byd Company Limited	1211 HK	4,315,973.06	0.58
7	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	4,260,122.95	0.58
8	China Mobile Limited	941 HK	4,234,011.99	0.57
9	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	3,786,319.78	0.51
10	Zijin Mining Group Company Limited	2899 HK	3,231,062.32	0.44
11	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	3,195,901.04	0.43
12	Jd Health	6618 HK	2,896,797.47	0.39

	International Inc.			
13	Bank of China Limited	3988 HK	2,884,054.25	0.39
14	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	2269 HK	2,414,196.21	0.33
15	Xiaomi Corporation	1810 HK	2,071,801.21	0.28
16	Galaxy Entertainment Group Limited	27 HK	1,913,950.81	0.26
17	Sun Hung Kai Properties Ltd.	16 HK	1,908,510.37	0.26
18	Cnooc Limited	883 HK	1,841,006.01	0.25
19	China Resources Power Holdings Co. Ltd.	836 HK	1,827,045.48	0.25
20	Techtronic Industries Co. Ltd.	669 HK	1,750,387.73	0.24

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

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

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Tencent Holdings Ltd	700 HK	46,079,644.31	6.23
2	HSBC Holdings plc	5 HK	34,018,786.11	4.60
3	Meituan	3690 HK	30,483,467.93	4.12
4	AIA Group Limited	1299 HK	22,884,317.96	3.10
5	China Construction Bank Corporation	939 HK	12,701,410.80	1.72
6	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	9,976,721.66	1.35
7	China Mobile Limited	941 HK	8,727,769.86	1.18
8	Ping An	2318 HK	8,613,408.73	1.17

	Insurance (Group) Company of China, Ltd.			
9	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	7,177,949.81	0.97
10	Byd Company Limited	1211 HK	6,639,544.26	0.90
11	Cnooc Limited	883 HK	5,638,994.20	0.76
12	Bank of China Limited	3988 HK	5,321,158.71	0.72
13	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	2269 HK	5,092,058.23	0.69
14	Xiaomi Corporation	1810 HK	4,800,753.42	0.65
15	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	4,324,090.10	0.58
16	Sun Hung Kai Properties Ltd.	16 HK	4,298,759.86	0.58
17	Techtronic Industries Co. Ltd.	669 HK	3,997,312.10	0.54
18	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	3,709,300.08	0.50
19	CK Hutchison Holdings Limited	1 HK	3,576,165.86	0.48
20	ANTA Sports Products Limited	2020 HK	3,505,120.68	0.47

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	136,710,727.18
卖出收入（成交）总额	303,980,142.79

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚；中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.10.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.10.3 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	8,320.30
2	应收清算款	-
3	应收股利	3,008,444.03
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	3,016,764.33

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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		南方恒生交易型开放 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
10,594	25,186.85	35,014,20 2.00	13.12%	132,737,5 22.00	49.75%	99,077,77 6.00	37.13%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	郭浩明	11,207,000.00	4.20%
2	BARCLAYS BANK PLC	6,714,328.00	2.52%
3	上海平谦科技有限公司	3,443,500.00	1.29%
4	深圳市凯丰投资管理有限公司-凯丰 宏观策略 18 号证券投资私募基金	2,963,800.00	1.11%
5	深圳市凯丰投资管理有限公司-凯丰 金选宏观策略 16 号证券投资私募基金	2,709,600.00	1.02%
6	广发证券资管-招商银行-广发资管兴 盛 1 号 FOF 集合资产管理计划	2,617,300.00	0.98%
7	光大证券资管-光大银行-光证资管诚	2,538,500.00	0.95%

	享 63 号集合资产管理计划		
8	李祥珍	1,861,700.00	0.70%
9	林巧钗	1,795,800.00	0.67%
10	陈浩钧	1,471,143.00	0.55%
11	中国工商银行股份有限公司-南方恒生交易型开放式指数证券投资基	99,077,776.00	37.13%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年12月23日)基金份额总额	286,959,921.00
本报告期期初基金份额总额	346,829,500.00
本报告期基金总申购份额	54,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	134,000,000.00
本报告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	266,829,500.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	1	314,465,539.41	72.25%	31,446.59	72.25%	-
华泰证券	2	120,799,842.88	27.75%	12,080.03	27.75%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；

2、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;

3、公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;

4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

B: 选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择席位:

1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C: 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

新增交易单元:

无

退租交易单元:

无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分基金2023年非港股通交易日申购赎回等业务安排的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-13
2	南方基金关于旗下部分基金增加国金证券为申	中国证券报、基金管	2023-03-22

	购赎回代理券商的公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
3	南方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金 2023 年非港股通交易日申购赎回等业务安排的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-24
4	南方基金关于旗下部分基金增加华宝证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-07
5	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-26
6	南方基金关于旗下部分基金增加华福证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20230101-20230630	101,474,576.00	3,947,800.00	6,344,600.00	99,077,776.00	37.13%

产品特有风险

本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立南方恒生交易型开放式指数证券投资基金的文件；

- 2、《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方恒生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、《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>