

南方中证 500 增强策略交易型开放式 指数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	10
§5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	54

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
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.....	59
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 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	112,080,333.00 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,346,570.34
本期利润	7,393,378.80
加权平均基金份额本期利润	0.0574
本期加权平均净值利润率	6.02%
本期基金份额净值增长率	5.29%
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	-5,591,246.20
期末可供分配基金份额利润	-0.0499
期末基金资产净值	106,489,086.80
期末基金份额净值	0.9501
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-4.99%

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。

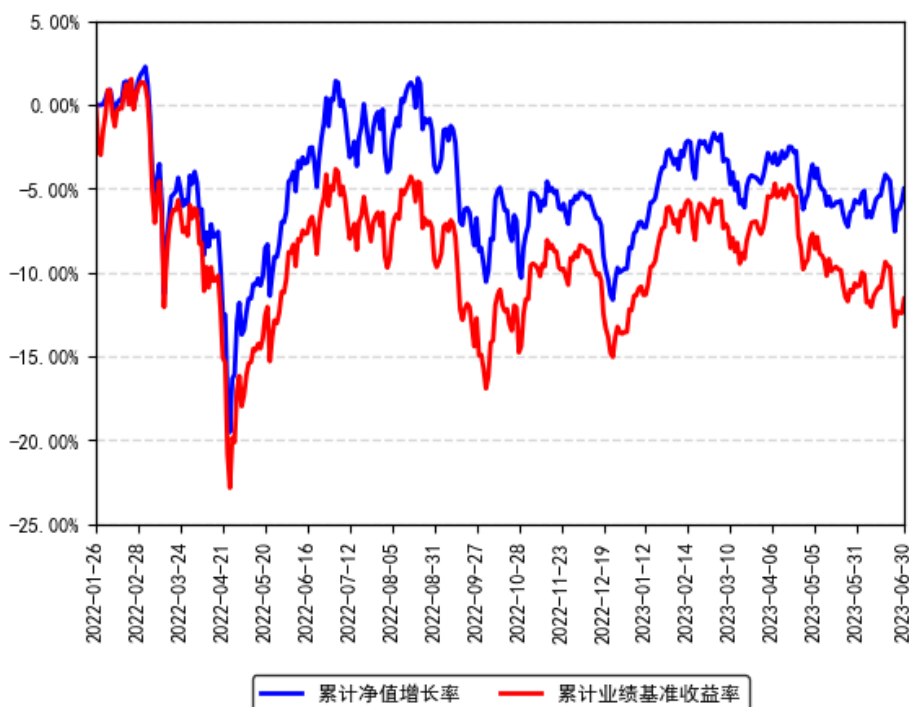
3.2 基金净值表现

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	0.85%	0.82%	-0.81%	0.93%	1.66%	-0.11%
过去三个月	-1.48%	0.72%	-5.38%	0.83%	3.90%	-0.11%
过去六个月	5.29%	0.71%	2.29%	0.79%	3.00%	-0.08%
过去一年	-5.32%	0.92%	-7.06%	0.96%	1.74%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-4.99%	1.16%	-11.56%	1.22%	6.57%	-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



注：本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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	证券	说明
----	----	-----------	----	----

		(助理) 期限		从业年限	
		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，金融风险管理师（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，历任数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；2018 年 11 月 8 日至今，任南方中证 500 增强基金经理；2019 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；2019 年 11 月 29 日至今，任南方粤港澳大湾区 ETF 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；2022 年 12 月 1 日至今，任南方上证科创板 50 成份增强策略 ETF 基金经理。

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内指数涨跌幅 2.29%，产品净值涨跌幅 5.29%，超额收益 3%。今年上半年 A 股市场多为震荡，虽然前期出现 TMT 与中特估双轮驱动的行市，但自 6 月起市场无热点、轮动快，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 0.9501 元，报告期内，份额净值增长率为 5.29%，同期业绩基准增长率为 2.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年为经济弱复苏、转折状态，类似 13、19 年，因此市场全年为主题投资年，整体宽基 ETF 配置价值降低，稳有余而攻不足。除了宏观环境，中证 500 指数在微观交易层面也受到场外衍生品的影响，今年波动显著降低，振幅空间小。展望下半年，我们关注几个重要指

标：海外加息节奏、国内居民中长贷同比、A 股新增入市资金。目前在国内流动性宽裕、且无确定热点的情况下，中证 500 仍相对大盘指数有优势。但随着顺周期行情，四季度市场可能会有中期变化。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对南方中证 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 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	4,293,022.59	1,219,561.60
结算备付金		4,905,078.92	9,440,791.44
存出保证金		1,047,334.51	1,694,117.05
交易性金融资产	6.4.3.2	96,688,806.32	111,955,770.82
其中：股票投资		96,688,806.32	111,955,770.82
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		60,044.78	112,894.98
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		106,994,287.12	124,423,135.89
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,472.81	15,476.51
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		50,420.48	55,147.22
应付托管费		5,042.05	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	6.4.3.6	448,264.98	191,937.88
负债合计		505,200.32	268,076.35
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	112,080,333.00	137,580,333.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	-5,591,246.20	-13,425,273.46
净资产合计		106,489,086.80	124,155,059.54
负债和净资产总计		106,994,287.12	124,423,135.89

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9501 元，基金份额总额 112,080,333.00 份。

6.2 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 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 26 日（基金合同 生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,814,218.25	584,496.86
1.利息收入		41,292.60	668,086.82
其中：存款利息收入	6.4.3.9	41,292.60	297,513.15
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
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		3,549,307.22	-10,167,317.05
其中：股票投资收益	6.4.3.10	2,168,733.59	-11,613,119.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	18,749.29	39,841.45
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.12	-421,079.15	-992,781.54
股利收益	6.4.3.13	1,782,903.49	2,398,742.46
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.3.14	4,046,808.46	8,671,885.27
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.3.15	176,809.97	1,411,841.82
减：二、营业总支出		420,839.45	655,757.02
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	305,586.36	566,060.58
2.托管费	6.4.6.2.2	30,558.67	56,606.03
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		213.24	0.13
8.其他费用	6.4.3.16	84,481.18	33,090.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,393,378.80	-71,260.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,393,378.80	-71,260.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,393,378.80	-71,260.16

6.3 净资产（基金净值）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 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）	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（基金净值）	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）	-25,500,000.00	-	7,834,027.26	-17,665,972.74
（一）、综合收益总额	-	-	7,393,378.80	7,393,378.80
（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）	-25,500,000.00	-	440,648.46	-25,059,351.54
其中：1.基金申购款	162,000,000.00	-	-7,520,675.01	154,479,324.99
2.基金赎回款	-187,500,000.00	-	7,961,323.47	-179,538,676.53

(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)	112,080,333.00	-	-5,591,246.20	106,489,086.80
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 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)	-	-	-	-
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)	746,580,333.00	-	-	746,580,333.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-600,000,000.00	-	509,838.41	-599,490,161.59
(一)、综合收益总额	-	-	-71,260.16	-71,260.16
(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)	-600,000,000.00	-	581,098.57	-599,418,901.43
其中: 1.基金申购款	247,500,000.00	-	-12,606,489.51	234,893,510.49
2.基金赎回款	-847,500,000.00	-	13,187,588.08	-834,312,411.92
(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)	146,580,333.00	-	509,838.41	147,090,171.41

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。

6.4.1.1 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	4,293,022.59
等于：本金	4,292,594.45
加：应计利息	428.14
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-

存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,293,022.59

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	96,901,234.93	-	96,688,806.32	-212,428.61
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	96,901,234.93	-	96,688,806.32	-212,428.61

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	8,444,920.00	-	-	-
一指期货	8,444,920.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,444,920.00	-	-	-

6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2307	IC2307	7.00	8,387,120.00	-57,800.00

合计	-57,800.00
减：可抵销期货暂收款	-57,800.00
净额	-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 其他资产

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	48,479.30
其中：交易所市场	48,479.30
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	314,995.02
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	-
可退替代款	488.10
其他	-
合计	448,264.98

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

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	137,580,333.00	137,580,333.00
本期申购	162,000,000.00	162,000,000.00
本期赎回 (以“-”号填列)	-187,500,000.00	-187,500,000.00
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	112,080,333.00	112,080,333.00

注:

1. 本基金自 2022 年 1 月 7 日至 2022 年 1 月 19 日止期间公开发售, 共募集有效净认购资金人民币 746,577,500.00 元, 折合为 746,577,500.00 份基金份额。根据《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的规定, 本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 2,833.00 元在本基金成立后, 折合为 2,833.00 份基金份额, 划入基金份额持有人账户。

2. 根据《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》、《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购与赎回业务的公告》的相关规定, 本基金于 2022 年 1 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 2 月 15 日止期间暂不向投资人开放基金交易, 申购业务和赎回业务自 2022 年 2 月 16 日起开始办理。

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	-4,964,255.20	-8,461,018.26	-13,425,273.46
本期利润	3,346,570.34	4,046,808.46	7,393,378.80
本期基金份额交易产生的变动数	353,694.47	86,953.99	440,648.46
其中: 基金申购款	-2,134,095.23	-5,386,579.78	-7,520,675.01
基金赎回款	2,487,789.70	5,473,533.77	7,961,323.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,263,990.39	-4,327,255.81	-5,591,246.20

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	5,001.14
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	35,936.51

其他	354.95
合计	41,292.60

6.4.3.10 股票投资收益

6.4.3.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,426,221.23
股票投资收益——赎回差价收入	742,512.36
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	2,168,733.59

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	451,892,482.20
减：卖出股票成本总额	449,853,759.48
减：交易费用	612,501.49
买卖股票差价收入	1,426,221.23

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	179,538,676.53
减：现金支付赎回款总额	84,410,374.53
减：赎回股票成本总额	94,385,789.64
减：交易费用	-
赎回差价收入	742,512.36

6.4.3.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.3.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.3.11 债券投资收益

6.4.3.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

债券投资收益——利息收入	13.95
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	18,735.34
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	18,749.29

6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	114,449.56
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	95,700.00
减：应计利息总额	14.22
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	18,735.34

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.3.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.3.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.3.12 衍生工具收益

6.4.3.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.3.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	-421,079.15

6.4.3.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,782,903.49
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	1,782,903.49

6.4.3.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	3,644,172.10
——股票投资	3,644,172.10
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	402,636.36
——权证投资	-
——期货投资	402,636.36
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	4,046,808.46

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

6.4.3.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	176,809.97
合计	176,809.97

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

6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	178.00
其他	0.62
合计	84,481.18

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、基金销售机构
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司

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 26 日 (基金合同生效日) 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	405,078,751.74	45.26%	698,745,739.68	38.67%
兴业证券	337,915,687.93	37.75%	316,225,039.21	17.50%

6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交 总额的比例	成交金额	占当期债券成交 总额的比例
华泰证券	101,582.53	88.76%	-	-
兴业证券	12,867.03	11.24%	73,874.46	25.17%

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	40,504.03	45.25%	22,792.87	47.02%
兴业证券	33,800.24	37.76%	19,040.90	39.28%
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 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	69,875.22	38.67%	10,247.85	30.17%
兴业证券	31,622.90	17.50%	11,271.46	33.18%

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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	305,586.36	566,060.58
其中：支付销售机构的客户维护费	8,024.35	8,768.79

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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	30,558.67	56,606.03

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 0.05% 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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 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	1,961,200.00	1.75%	2,283,600.00	1.66%

注：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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

			月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	4,293,022.59	5,001.14	2,807,388.96	38,399.22

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

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	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
兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	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 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	6,035	135,968.55
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	1,417	114,493.60

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688603	天承科技	2023	1 个月	新股未	55.00	55.00	591	32,505.00	32,505.00	-

		年 6 月 30 日	内(含)	上市						
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	19.86	18.06	716	14,219.76	12,930.96	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	23.60	64.67	113	2,666.80	7,307.71	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	37.88	29.49	234	8,863.92	6,900.66	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	5.69	5.41	1,270	7,226.30	6,870.70	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	9.26	18.59	353	3,268.78	6,562.27	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	32.52	42.37	137	4,455.24	5,804.69	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	26.74	40.68	130	3,476.20	5,288.40	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	12.68	22.31	227	2,878.36	5,064.37	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	135.8 0	120.4 1	40	5,432.00	4,816.40	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	10.68	12.34	382	4,079.76	4,713.88	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	36.15	38.13	116	4,193.40	4,423.08	-
688352	硕中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	12.10	12.07	355	4,295.50	4,284.85	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	75.00	90.76	47	3,525.00	4,265.72	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	14.16	16.21	260	3,681.60	4,214.60	-

688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	43.67	53.05	79	3,449.93	4,190.95	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	19.20	25.53	149	2,860.80	3,803.97	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	35.00	51.23	73	2,555.00	3,739.79	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	20.92	19.16	184	3,849.28	3,525.44	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	30.26	25.33	139	4,206.14	3,520.87	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁 定期	26.66	31.50	111	2,959.26	3,496.50	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	25.28	29.87	104	2,629.12	3,106.48	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	6.58	7.58	402	2,645.16	3,047.16	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	125.8 8	86.79	32	4,028.16	2,777.28	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	33.99	29.49	78	2,651.22	2,300.22	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	11.66	12.26	133	1,550.78	1,630.58	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	10.36	11.84	136	1,408.96	1,610.24	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	14.58	16.13	86	1,253.88	1,387.18	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	25.98	24.53	44	1,143.12	1,079.32	-

6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

证券代	证券名称	成功认	受限期	流通受	认购	期末	数量	期末成本总	期末估值总	备
-----	------	-----	-----	-----	----	----	----	-------	-------	---

码		购日		限类型	价格	估值 单价	(单位 张)	额	额	注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌开 盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023 年 6 月 28 日	重大事项停牌	6.97	2023 年 7 月 3 日	7.40	43,500	311,098.48	303,195.00	-

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

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 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。

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。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.9.3 流动性风险

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资股指期货，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头

或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,293,022.59	-	-	-	4,293,022.59
结算备付金	4,905,078.92	-	-	-	4,905,078.92
存出保证金	40,880.11	-	-	1,006,454.40	1,047,334.51
交易性金融 资产	-	-	-	96,688,806.3 2	96,688,806.3 2
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	-	-	-	60,044.78	60,044.78
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,238,981.62	-	-	97,755,305.5 0	106,994,287. 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	-	-	-	1,472.81	1,472.81
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	50,420.48	50,420.48
应付托管费	-	-	-	5,042.05	5,042.05
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	-	-	-	448,264.98	448,264.98
负债总计	-	-	-	505,200.32	505,200.32
利率敏感度 缺口	9,238,981.62	-	-	97,250,105.1 8	106,489,086. 80
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	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	10,709,638.0 9	-	-	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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

本基金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。

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	96,688,806.32	90.80	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	96,688,806.32	90.80	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。

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%	4,944,143.35	5,925,077.64
	2.组合自身基准下降 5%	-4,944,143.35	-5,925,077.64

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	96,230,442.05
第二层次	335,700.00
第三层次	122,664.27
合计	96,688,806.32

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

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	96,688,806.32	90.37
	其中：股票	96,688,806.32	90.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融	-	-

	资产		
7	银行存款和结算备付金合计	9,198,101.51	8.60
8	其他资产	1,107,379.29	1.03
9	合计	106,994,287.12	100.00

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

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	915,280.00	0.86
B	采矿业	2,627,570.50	2.47
C	制造业	62,802,717.04	58.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,486,049.00	3.27
E	建筑业	2,399,708.40	2.25
F	批发和零售业	3,883,327.76	3.65
G	交通运输、仓储和邮政业	2,138,211.00	2.01
H	住宿和餐饮业	8,468.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,695,889.07	5.35
J	金融业	4,553,749.40	4.28
K	房地产业	1,720,578.60	1.62
L	租赁和商务服务业	817,325.30	0.77
M	科学研究和技术服务业	489,983.04	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	1,534,622.94	1.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	161,577.00	0.15
Q	卫生和社会工作	5,126.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,999,983.00	1.88
S	综合	190,344.00	0.18
	合计	95,430,510.05	89.62

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	930,827.86	0.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,630.58	0.00

F	批发和零售业	3,047.16	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	318,351.07	0.30
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	4,214.60	0.00
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	1,258,071.27	1.18

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	7,500	1,105,875.00	1.04
2	300146	汤臣倍健	36,200	868,076.00	0.82
3	002422	科伦药业	27,800	825,104.00	0.77
4	600582	天地科技	140,600	819,698.00	0.77
5	000783	长江证券	133,700	775,460.00	0.73
6	603156	养元饮品	31,000	765,700.00	0.72
7	600066	宇通客车	49,900	735,526.00	0.69
8	603228	景旺电子	28,308	726,100.20	0.68
9	600398	海澜之家	105,100	723,088.00	0.68
10	600998	九州通	66,787	693,249.06	0.65
11	000997	新大陆	36,000	680,400.00	0.64
12	000623	吉林敖东	41,800	670,472.00	0.63
13	600820	隧道股份	108,000	649,080.00	0.61
14	600598	北大荒	48,000	639,840.00	0.60
15	002128	电投能源	46,500	614,730.00	0.58
16	600642	申能股份	85,700	599,043.00	0.56
17	600885	宏发股份	18,600	592,410.00	0.56

18	688188	柏楚电子	3,108	586,044.48	0.55
19	600516	方大炭素	94,000	582,800.00	0.55
20	002867	周大生	32,600	579,628.00	0.54
21	600131	国网信通	28,700	579,453.00	0.54
22	300866	安克创新	6,601	577,587.50	0.54
23	600580	卧龙电驱	39,200	572,712.00	0.54
24	000513	丽珠集团	14,600	568,086.00	0.53
25	688516	奥特维	2,987	562,750.80	0.53
26	688301	奕瑞科技	1,949	550,456.07	0.52
27	600637	东方明珠	70,100	548,182.00	0.51
28	600377	宁沪高速	54,400	534,752.00	0.50
29	601098	中南传媒	45,500	527,800.00	0.50
30	300003	乐普医疗	23,300	526,813.00	0.49
31	002249	大洋电机	92,100	524,970.00	0.49
32	002244	滨江集团	58,500	515,970.00	0.48
33	002563	森马服饰	82,300	511,906.00	0.48
34	603816	顾家家居	13,200	503,580.00	0.47
35	002384	东山精密	19,300	499,870.00	0.47
36	603338	浙江鼎力	8,900	498,489.00	0.47
37	600060	海信视像	20,100	497,475.00	0.47
38	000423	东阿阿胶	9,300	497,085.00	0.47
39	601928	凤凰传媒	43,600	497,040.00	0.47
40	300888	稳健医疗	11,920	496,706.40	0.47
41	000739	普洛药业	27,600	489,624.00	0.46
42	688819	天能股份	13,255	488,314.20	0.46
43	000060	中金岭南	102,300	485,925.00	0.46
44	603233	大参林	17,320	485,133.20	0.46
45	600566	济川药业	16,600	482,064.00	0.45
46	002025	航天电器	7,500	478,500.00	0.45
47	603444	吉比特	970	476,376.70	0.45
48	002056	横店东磁	25,700	467,997.00	0.44
49	688009	中国通号	79,443	460,769.40	0.43
50	002595	豪迈科技	13,000	456,690.00	0.43
51	600985	淮北矿业	39,000	449,280.00	0.42
52	002745	木林森	48,600	447,120.00	0.42
53	000156	华数传媒	51,200	445,440.00	0.42
54	600901	江苏金租	107,480	443,892.40	0.42
55	300487	蓝晓科技	6,950	433,819.00	0.41
56	002600	领益智造	62,100	429,111.00	0.40
57	000630	铜陵有色	146,200	422,518.00	0.40
58	600535	天士力	29,100	422,241.00	0.40
59	300136	信维通信	20,900	419,672.00	0.39
60	600517	国网英大	73,500	418,950.00	0.39

61	688390	固德威	2,473	412,644.78	0.39
62	603688	石英股份	3,598	409,596.32	0.38
63	600380	健康元	32,200	409,262.00	0.38
64	600329	达仁堂	9,100	408,499.00	0.38
65	601158	重庆水务	73,400	408,104.00	0.38
66	002273	水晶光电	33,900	404,766.00	0.38
67	000012	南玻 A	67,700	403,492.00	0.38
68	000027	深圳能源	61,100	402,649.00	0.38
69	600170	上海建工	148,800	400,272.00	0.38
70	600563	法拉电子	2,900	398,170.00	0.37
71	688777	中控技术	6,311	396,204.58	0.37
72	000967	盈峰环境	77,700	392,385.00	0.37
73	600699	均胜电子	22,200	391,608.00	0.37
74	600167	联美控股	55,100	384,047.00	0.36
75	002409	雅克科技	5,200	378,976.00	0.36
76	000709	河钢股份	165,200	373,352.00	0.35
77	600487	亨通光电	25,200	369,432.00	0.35
78	300037	新宙邦	7,100	368,419.00	0.35
79	600177	雅戈尔	57,800	364,718.00	0.34
80	688029	南微医学	4,453	363,186.68	0.34
81	600282	南钢股份	107,700	362,949.00	0.34
82	002081	金螳螂	80,200	361,702.00	0.34
83	002508	老板电器	14,200	359,118.00	0.34
84	002738	中矿资源	7,000	356,580.00	0.33
85	601108	财通证券	48,000	347,520.00	0.33
86	600511	国药股份	8,900	345,765.00	0.32
87	601000	唐山港	95,100	335,703.00	0.32
88	601717	郑煤机	26,300	327,435.00	0.31
89	300009	安科生物	32,200	322,000.00	0.30
90	000869	张裕 A	10,500	321,930.00	0.30
91	002152	广电运通	27,400	321,128.00	0.30
92	000878	云南铜业	28,700	317,135.00	0.30
93	002531	天顺风能	20,300	309,169.00	0.29
94	600967	内蒙一机	30,400	307,040.00	0.29
95	688551	科威尔	4,674	306,520.92	0.29
96	002138	顺络电子	12,800	306,048.00	0.29
97	603218	日月股份	16,100	305,739.00	0.29
98	601298	青岛港	43,500	303,195.00	0.28
99	000729	燕京啤酒	24,200	301,774.00	0.28
100	002568	百润股份	8,200	298,070.00	0.28
101	600988	赤峰黄金	22,100	297,466.00	0.28
102	002507	涪陵榨菜	16,120	295,157.20	0.28
103	600755	厦门国贸	38,100	294,894.00	0.28

104	600373	中文传媒	22,100	294,372.00	0.28
105	000039	中集集团	42,600	293,514.00	0.28
106	000400	许继电气	12,700	292,735.00	0.27
107	600655	豫园股份	42,600	292,236.00	0.27
108	603868	飞科电器	4,600	290,214.00	0.27
109	000559	万向钱潮	53,200	289,940.00	0.27
110	600325	华发股份	29,300	288,605.00	0.27
111	002372	伟星新材	14,000	287,560.00	0.27
112	603596	伯特利	3,600	285,336.00	0.27
113	002266	浙富控股	69,000	284,970.00	0.27
114	601139	深圳燃气	38,800	282,852.00	0.27
115	603712	七一二	9,100	274,911.00	0.26
116	603568	伟明环保	15,700	274,907.00	0.26
117	000598	兴蓉环境	50,500	274,215.00	0.26
118	600968	海油发展	88,200	270,774.00	0.25
119	688006	杭可科技	8,811	268,471.17	0.25
120	688536	思瑞浦	1,219	265,742.00	0.25
121	600546	山煤国际	18,200	263,354.00	0.25
122	601869	长飞光纤	7,100	262,771.00	0.25
123	600801	华新水泥	21,100	260,585.00	0.24
124	002032	苏泊尔	5,200	260,000.00	0.24
125	600350	山东高速	40,800	259,896.00	0.24
126	300088	长信科技	43,100	259,893.00	0.24
127	002065	东华软件	36,800	259,808.00	0.24
128	300127	银河磁体	14,200	257,446.00	0.24
129	688082	盛美上海	2,318	255,907.20	0.24
130	600390	五矿资本	47,200	253,936.00	0.24
131	300418	昆仑万维	6,200	249,736.00	0.23
132	000898	鞍钢股份	89,300	248,254.00	0.23
133	600667	太极实业	34,000	246,840.00	0.23
134	688378	奥来德	4,947	244,381.80	0.23
135	301029	怡合达	5,460	243,952.80	0.23
136	002299	圣农发展	12,700	243,205.00	0.23
137	688120	华海清科	958	241,463.90	0.23
138	002936	郑州银行	103,800	238,740.00	0.22
139	600623	华谊集团	38,100	237,363.00	0.22
140	601611	中国核建	27,700	234,065.00	0.22
141	002203	海亮股份	19,400	232,994.00	0.22
142	002465	海格通信	22,400	231,616.00	0.22
143	603199	九华旅游	6,700	231,485.00	0.22
144	000048	京基智农	11,800	230,336.00	0.22
145	002500	山西证券	41,100	229,338.00	0.22
146	600528	中铁工业	23,200	229,216.00	0.22

147	603355	莱克电气	9,000	228,690.00	0.21
148	600597	光明乳业	21,800	226,720.00	0.21
149	601231	环旭电子	15,100	225,896.00	0.21
150	001914	招商积余	15,000	225,750.00	0.21
151	688556	高测股份	4,226	224,569.64	0.21
152	002532	天山铝业	36,700	219,833.00	0.21
153	603927	中科软	5,700	219,792.00	0.21
154	600873	梅花生物	24,200	216,106.00	0.20
155	601958	金钼股份	19,300	215,195.00	0.20
156	002034	旺能环境	13,500	213,435.00	0.20
157	000830	鲁西化工	19,900	210,144.00	0.20
158	300682	朗新科技	9,000	209,520.00	0.20
159	600867	通化东宝	19,900	207,756.00	0.20
160	600499	科达制造	18,100	205,616.00	0.19
161	300856	科思股份	2,600	204,802.00	0.19
162	688208	道通科技	6,708	203,319.48	0.19
163	600153	建发股份	18,600	202,926.00	0.19
164	301043	绿岛风	6,300	201,411.00	0.19
165	605266	健之佳	2,400	201,192.00	0.19
166	603737	三棵树	3,060	200,185.20	0.19
167	601966	玲珑轮胎	9,000	199,980.00	0.19
168	300615	欣天科技	11,300	199,897.00	0.19
169	002925	盈趣科技	10,200	197,880.00	0.19
170	002468	申通快递	18,200	196,924.00	0.18
171	300442	润泽科技	6,400	196,864.00	0.18
172	000750	国海证券	57,100	191,285.00	0.18
173	300951	博硕科技	3,500	191,205.00	0.18
174	600673	东阳光	26,400	190,344.00	0.18
175	000988	华工科技	5,000	190,050.00	0.18
176	603589	口子窖	3,800	187,530.00	0.18
177	002028	思源电气	4,000	186,880.00	0.18
178	000778	新兴铸管	45,500	185,640.00	0.17
179	688019	安集科技	1,124	185,268.92	0.17
180	002690	美亚光电	7,170	184,627.50	0.17
181	000883	湖北能源	40,300	183,768.00	0.17
182	300529	健帆生物	7,900	183,122.00	0.17
183	603267	鸿远电子	2,800	182,840.00	0.17
184	688248	南网科技	4,756	182,582.84	0.17
185	601666	平煤股份	24,200	182,468.00	0.17
186	601866	中远海发	73,100	180,557.00	0.17
187	002010	传化智联	33,800	179,816.00	0.17
188	600271	航天信息	13,100	179,339.00	0.17
189	000031	大悦城	48,900	178,974.00	0.17

190	600369	西南证券	48,600	177,390.00	0.17
191	000987	越秀资本	27,800	176,530.00	0.17
192	000932	华菱钢铁	36,700	175,059.00	0.16
193	600486	扬农化工	2,000	174,840.00	0.16
194	600782	新钢股份	46,500	172,515.00	0.16
195	300474	景嘉微	1,900	170,981.00	0.16
196	601598	中国外运	36,300	169,158.00	0.16
197	600415	小商品城	19,700	168,041.00	0.16
198	003011	海象新材	5,200	167,700.00	0.16
199	600663	陆家嘴	16,900	166,803.00	0.16
200	002459	晶澳科技	3,980	165,966.00	0.16
201	603368	柳药集团	6,700	165,557.00	0.16
202	603658	安图生物	3,200	165,536.00	0.16
203	603866	桃李面包	16,340	165,360.80	0.16
204	002444	巨星科技	7,500	164,100.00	0.15
205	600507	方大特钢	35,400	163,902.00	0.15
206	605259	绿田机械	4,200	163,044.00	0.15
207	300236	上海新阳	4,100	162,565.00	0.15
208	300839	博汇股份	12,140	161,340.60	0.15
209	600418	江淮汽车	12,800	161,152.00	0.15
210	002966	苏州银行	24,600	161,130.00	0.15
211	300861	美畅股份	3,700	160,469.00	0.15
212	601162	天风证券	53,500	159,430.00	0.15
213	002572	索菲亚	9,100	158,522.00	0.15
214	002223	鱼跃医疗	4,400	158,356.00	0.15
215	600126	杭钢股份	36,400	157,976.00	0.15
216	601568	北元集团	29,900	157,573.00	0.15
217	600161	天坛生物	5,800	157,470.00	0.15
218	600096	云天化	9,100	155,337.00	0.15
219	600062	华润双鹤	8,900	155,038.00	0.15
220	300058	蓝色光标	16,000	154,720.00	0.15
221	300741	华宝股份	7,200	154,224.00	0.14
222	600681	百川能源	32,500	151,775.00	0.14
223	000999	华润三九	2,500	151,650.00	0.14
224	000937	冀中能源	23,700	151,206.00	0.14
225	600308	华泰股份	40,600	151,032.00	0.14
226	603277	银都股份	6,900	150,696.00	0.14
227	600160	巨化股份	10,900	150,202.00	0.14
228	002603	以岭药业	5,800	149,002.00	0.14
229	601699	潞安环能	9,100	148,512.00	0.14
230	002274	华昌化工	19,800	148,302.00	0.14
231	600261	阳光照明	40,200	146,730.00	0.14
232	002439	启明星辰	4,900	145,824.00	0.14

233	002884	凌霄泵业	9,500	144,875.00	0.14
234	600879	航天电子	17,000	144,330.00	0.14
235	002267	陕天然气	18,200	144,144.00	0.14
236	002275	桂林三金	8,000	144,080.00	0.14
237	600741	华域汽车	7,800	143,988.00	0.14
238	000738	航发控制	5,900	143,960.00	0.14
239	000563	陕国投 A	47,100	143,655.00	0.13
240	603758	秦安股份	13,500	143,640.00	0.13
241	600348	华阳股份	18,150	143,566.50	0.13
242	600027	华电国际	21,400	143,166.00	0.13
243	603360	百傲化学	14,000	141,960.00	0.13
244	600039	四川路桥	14,440	141,656.40	0.13
245	600970	中材国际	11,100	141,525.00	0.13
246	600643	爱建集团	28,300	141,500.00	0.13
247	002538	司尔特	21,400	141,454.00	0.13
248	600416	湘电股份	7,400	141,266.00	0.13
249	002543	万和电气	17,800	140,798.00	0.13
250	603726	朗迪集团	11,100	140,526.00	0.13
251	000030	富奥股份	27,800	140,112.00	0.13
252	000887	中鼎股份	10,700	140,063.00	0.13
253	603115	海星股份	9,100	139,867.00	0.13
254	603303	得邦照明	10,100	139,481.00	0.13
255	600997	开滦股份	23,200	138,504.00	0.13
256	601126	四方股份	9,100	138,229.00	0.13
257	000636	风华高科	9,000	138,060.00	0.13
258	600064	南京高科	20,760	137,223.60	0.13
259	603706	东方环宇	9,100	136,955.00	0.13
260	600057	厦门象屿	15,700	136,590.00	0.13
261	688057	金达莱	9,578	136,294.94	0.13
262	000090	天健集团	27,000	136,080.00	0.13
263	603386	骏亚科技	11,900	135,065.00	0.13
264	000895	双汇发展	5,500	134,695.00	0.13
265	603700	宁水集团	9,200	134,504.00	0.13
266	002658	雪迪龙	16,500	134,145.00	0.13
267	002416	爱施德	18,100	133,578.00	0.13
268	603587	地素时尚	9,100	133,224.00	0.13
269	002683	广东宏大	4,500	132,480.00	0.12
270	600845	宝信软件	2,600	132,106.00	0.12
271	002368	太极股份	3,200	131,744.00	0.12
272	002991	甘源食品	1,700	130,390.00	0.12
273	300842	帝科股份	1,400	128,016.00	0.12
274	300017	网宿科技	18,000	127,980.00	0.12
275	002475	立讯精密	3,900	126,555.00	0.12

276	688234	天岳先进	1,711	126,511.34	0.12
277	600143	金发科技	14,400	125,712.00	0.12
278	300115	长盈精密	10,500	125,055.00	0.12
279	000733	振华科技	1,300	124,605.00	0.12
280	002835	同为股份	5,400	122,688.00	0.12
281	688395	正弦电气	4,540	120,718.60	0.11
282	688617	惠泰医疗	319	119,226.25	0.11
283	000930	中粮科技	14,500	117,450.00	0.11
284	601555	东吴证券	16,700	115,898.00	0.11
285	600095	湘财股份	14,800	115,440.00	0.11
286	002739	万达电影	9,200	115,368.00	0.11
287	002985	北摩高科	2,600	114,712.00	0.11
288	002423	中粮资本	14,300	114,400.00	0.11
289	600848	上海临港	9,500	113,525.00	0.11
290	300857	协创数据	4,300	113,004.00	0.11
291	300494	盛天网络	4,500	111,555.00	0.10
292	688200	华峰测控	726	111,078.00	0.10
293	688190	云路股份	1,514	110,522.00	0.10
294	600315	上海家化	3,800	110,238.00	0.10
295	688357	建龙微纳	1,704	110,231.76	0.10
296	002791	坚朗五金	1,700	110,007.00	0.10
297	002705	新宝股份	6,100	109,983.00	0.10
298	603551	奥普家居	8,500	109,905.00	0.10
299	688335	复洁环保	4,445	109,080.30	0.10
300	603127	昭衍新药	2,660	108,794.00	0.10
301	603501	韦尔股份	1,100	107,844.00	0.10
302	688281	华秦科技	524	106,110.00	0.10
303	688032	禾迈股份	298	105,834.70	0.10
304	603786	科博达	1,600	105,120.00	0.10
305	603339	四方科技	6,600	105,006.00	0.10
306	688276	百克生物	1,670	104,542.00	0.10
307	600927	永安期货	6,400	104,064.00	0.10
308	688100	威胜信息	3,476	103,619.56	0.10
309	600038	中直股份	2,600	103,532.00	0.10
310	002890	弘宇股份	7,000	103,390.00	0.10
311	300553	集智股份	1,800	102,204.00	0.10
312	603883	老百姓	3,390	101,191.50	0.10
313	002011	盾安环境	7,300	100,959.00	0.09
314	600104	上汽集团	7,100	100,607.00	0.09
315	600008	首创环保	34,900	100,512.00	0.09
316	603517	绝味食品	2,700	100,305.00	0.09
317	300672	国科微	1,200	100,020.00	0.09
318	300445	康斯特	6,300	99,855.00	0.09

319	002373	千方科技	7,300	99,572.00	0.09
320	002156	通富微电	4,400	99,440.00	0.09
321	002017	东信和平	7,580	99,373.80	0.09
322	300869	康泰医学	4,300	98,728.00	0.09
323	300345	红宇新材	9,400	98,324.00	0.09
324	601577	长沙银行	12,600	97,776.00	0.09
325	603367	辰欣药业	6,400	97,152.00	0.09
326	002588	史丹利	15,900	96,672.00	0.09
327	603050	科林电气	6,000	96,660.00	0.09
328	603519	立霸股份	6,500	96,330.00	0.09
329	603878	武进不锈	11,380	96,161.00	0.09
330	000707	双环科技	11,300	96,050.00	0.09
331	603630	拉芳家化	6,000	95,820.00	0.09
332	603488	展鹏科技	11,900	95,557.00	0.09
333	688626	翔宇医疗	2,059	93,705.09	0.09
334	600858	银座股份	15,500	93,620.00	0.09
335	603215	比依股份	5,200	93,288.00	0.09
336	601702	华峰铝业	6,800	93,024.00	0.09
337	002832	比音勒芬	2,600	92,066.00	0.09
338	002990	盛视科技	2,500	92,000.00	0.09
339	300795	米奥会展	2,200	91,762.00	0.09
340	600859	王府井	4,600	91,034.00	0.09
341	300416	苏试试验	4,220	90,983.20	0.09
342	002608	江苏国信	12,000	90,840.00	0.09
343	688722	同益中	4,864	90,178.56	0.08
344	002215	诺普信	11,900	89,369.00	0.08
345	600363	联创光电	2,400	89,040.00	0.08
346	600827	百联股份	6,600	88,242.00	0.08
347	603345	安井食品	600	88,080.00	0.08
348	300853	申昊科技	2,500	87,750.00	0.08
349	300833	浩洋股份	800	87,544.00	0.08
350	300514	友讯达	6,000	87,540.00	0.08
351	688510	航亚科技	4,369	86,899.41	0.08
352	301102	兆讯传媒	3,190	85,715.30	0.08
353	300747	锐科激光	2,800	85,344.00	0.08
354	605287	德才股份	3,600	85,320.00	0.08
355	301085	亚康股份	1,200	84,648.00	0.08
356	600529	山东药玻	3,100	84,382.00	0.08
357	603103	横店影视	5,000	84,200.00	0.08
358	300872	天阳科技	5,400	83,916.00	0.08
359	300638	广和通	3,700	83,916.00	0.08
360	301086	鸿富瀚	1,650	83,655.00	0.08
361	600455	博通股份	3,700	83,583.00	0.08

362	688456	有研粉材	2,493	83,440.71	0.08
363	600129	太极集团	1,400	83,286.00	0.08
364	600419	天润乳业	5,100	82,722.00	0.08
365	688021	奥福环保	3,166	82,062.72	0.08
366	688310	迈得医疗	2,494	81,728.38	0.08
367	002078	太阳纸业	7,600	81,244.00	0.08
368	603129	春风动力	500	80,950.00	0.08
369	300619	金银河	1,300	80,535.00	0.08
370	601021	春秋航空	1,400	80,458.00	0.08
371	603180	金牌厨柜	2,400	80,448.00	0.08
372	603031	安孚科技	1,700	79,985.00	0.08
373	603661	恒林股份	2,400	79,584.00	0.07
374	000951	中国重汽	4,700	79,195.00	0.07
375	688655	迅捷兴	4,777	78,533.88	0.07
376	300192	科德教育	6,300	77,994.00	0.07
377	601003	柳钢股份	19,300	77,972.00	0.07
378	688020	方邦股份	1,551	77,503.47	0.07
379	603529	爱玛科技	2,400	77,328.00	0.07
380	002381	双箭股份	10,000	77,200.00	0.07
381	603195	公牛集团	800	76,848.00	0.07
382	002110	三钢闽光	18,200	76,804.00	0.07
383	300130	新国都	2,700	76,491.00	0.07
384	688318	财富趋势	764	76,377.08	0.07
385	002831	裕同科技	3,100	75,609.00	0.07
386	603719	良品铺子	2,900	72,529.00	0.07
387	600173	卧龙地产	13,700	72,199.00	0.07
388	603208	江山欧派	1,950	71,019.00	0.07
389	600612	老凤祥	1,000	69,880.00	0.07
390	603829	洛凯股份	4,300	69,703.00	0.07
391	603689	皖天然气	7,900	69,283.00	0.07
392	001872	招商港口	4,000	69,080.00	0.06
393	300577	开润股份	4,200	68,418.00	0.06
394	600728	佳都科技	9,700	67,221.00	0.06
395	002988	豪美新材	3,900	66,651.00	0.06
396	300811	铂科新材	1,080	64,195.20	0.06
397	002641	公元股份	11,300	63,732.00	0.06
398	603970	中农立华	3,200	63,584.00	0.06
399	601010	文峰股份	25,900	63,455.00	0.06
400	688211	中科微至	1,380	62,334.60	0.06
401	600694	大商股份	3,300	58,509.00	0.05
402	300668	杰恩设计	2,500	58,375.00	0.05
403	600633	浙数文化	3,500	56,735.00	0.05
404	000544	中原环保	7,800	56,004.00	0.05

405	688669	聚石化学	3,089	56,003.57	0.05
406	603121	华培动力	6,000	53,460.00	0.05
407	300314	戴维医疗	2,400	50,736.00	0.05
408	603855	华荣股份	1,900	50,540.00	0.05
409	000858	五粮液	300	49,071.00	0.05
410	601163	三角轮胎	3,000	47,610.00	0.04
411	603899	晨光股份	1,000	44,640.00	0.04
412	600155	华创云信	7,000	43,540.00	0.04
413	300390	天华新能	1,190	42,602.00	0.04
414	300697	电工合金	3,200	38,336.00	0.04
415	000591	太阳能	5,400	36,612.00	0.03
416	002019	亿帆医药	2,500	36,500.00	0.03
417	600109	国金证券	4,200	36,414.00	0.03
418	600481	双良节能	2,600	36,348.00	0.03
419	601019	山东出版	3,900	35,763.00	0.03
420	301257	普蕊斯	600	33,720.00	0.03
421	000998	隆平高科	2,100	32,235.00	0.03
422	603527	众源新材	2,400	29,328.00	0.03
423	688682	霍莱沃	327	27,382.98	0.03
424	002324	普利特	1,900	27,113.00	0.03
425	600498	烽火通信	1,300	26,481.00	0.02
426	002250	联化科技	2,500	26,150.00	0.02
427	002625	光启技术	1,700	25,942.00	0.02
428	002900	哈三联	1,900	25,403.00	0.02
429	000893	亚钾国际	1,100	25,234.00	0.02
430	601908	京运通	4,100	24,805.00	0.02
431	002402	和而泰	1,400	23,772.00	0.02
432	603026	胜华新材	400	23,700.00	0.02
433	000333	美的集团	400	23,568.00	0.02
434	300724	捷佳伟创	200	22,470.00	0.02
435	000568	泸州老窖	100	20,957.00	0.02
436	002463	沪电股份	1,000	20,940.00	0.02
437	000728	国元证券	3,200	20,864.00	0.02
438	002926	华西证券	2,500	20,775.00	0.02
439	601636	旗滨集团	2,400	20,688.00	0.02
440	300496	中科创达	200	19,270.00	0.02
441	300438	鹏辉能源	400	19,216.00	0.02
442	000301	东方盛虹	1,600	18,912.00	0.02
443	002340	格林美	2,600	17,966.00	0.02
444	601128	常熟银行	2,500	17,050.00	0.02
445	000807	云铝股份	1,300	16,549.00	0.02
446	002518	科士达	400	16,004.00	0.02
447	300674	宇信科技	900	15,912.00	0.01

448	603330	天洋新材	1,400	15,554.00	0.01
449	002865	钧达股份	100	15,253.00	0.01
450	000975	银泰黄金	1,300	15,210.00	0.01
451	002506	协鑫集成	4,700	13,771.00	0.01
452	600639	浦东金桥	1,100	13,651.00	0.01
453	300383	光环新网	1,200	12,900.00	0.01
454	002478	常宝股份	1,700	12,665.00	0.01
455	002353	杰瑞股份	500	12,565.00	0.01
456	300012	华测检测	600	11,700.00	0.01
457	300776	帝尔激光	180	11,682.00	0.01
458	688711	宏微科技	200	11,668.00	0.01
459	002233	塔牌集团	1,500	11,580.00	0.01
460	603456	九洲药业	400	10,952.00	0.01
461	601515	东风股份	2,500	10,950.00	0.01
462	600592	龙溪股份	1,000	10,600.00	0.01
463	300568	星源材质	600	10,314.00	0.01
464	301087	可孚医疗	200	9,860.00	0.01
465	000685	中山公用	1,300	9,841.00	0.01
466	688599	天合光能	225	9,587.25	0.01
467	002004	华邦健康	1,900	9,500.00	0.01
468	301039	中集车辆	700	9,261.00	0.01
469	000063	中兴通讯	200	9,108.00	0.01
470	000409	云鼎科技	900	8,991.00	0.01
471	603283	赛腾股份	200	8,900.00	0.01
472	002497	雅化集团	500	8,890.00	0.01
473	300969	恒帅股份	100	8,815.00	0.01
474	601997	贵阳银行	1,700	8,772.00	0.01
475	600754	锦江酒店	200	8,468.00	0.01
476	688187	时代电气	200	8,372.00	0.01
477	600683	京投发展	1,300	7,878.00	0.01
478	002160	常铝股份	1,900	7,676.00	0.01
479	600183	生益科技	500	7,100.00	0.01
480	301266	宇邦新材	100	7,031.00	0.01
481	002555	三七互娱	200	6,976.00	0.01
482	688223	晶科能源	492	6,917.52	0.01
483	002192	融捷股份	100	6,683.00	0.01
484	600863	内蒙华电	1,600	6,640.00	0.01
485	301089	拓新药业	100	6,194.00	0.01
486	600399	抚顺特钢	600	6,120.00	0.01
487	688676	金盘科技	200	6,058.00	0.01
488	603757	大元泵业	200	5,968.00	0.01
489	300832	新产业	100	5,900.00	0.01
490	603696	安记食品	600	5,664.00	0.01

491	300244	迪安诊断	200	5,126.00	0.00
492	002334	英威腾	400	5,096.00	0.00
493	600026	中远海能	400	5,056.00	0.00
494	603628	清源股份	300	4,749.00	0.00
495	002746	仙坛股份	600	4,728.00	0.00
496	002252	上海莱士	600	4,506.00	0.00
497	000906	浙商中拓	500	4,460.00	0.00
498	600732	爱旭股份	140	4,305.00	0.00
499	600180	瑞茂通	700	4,186.00	0.00
500	000912	泸天化	900	4,122.00	0.00
501	300532	今天国际	200	4,112.00	0.00
502	002080	中材科技	200	4,104.00	0.00
503	300759	康龙化成	100	3,828.00	0.00
504	605388	均瑶健康	300	3,813.00	0.00
505	300699	光威复材	120	3,702.00	0.00
506	002558	巨人网络	200	3,586.00	0.00
507	600821	金开新能	500	3,445.00	0.00
508	601975	招商南油	1,200	3,432.00	0.00
509	600502	安徽建工	600	3,168.00	0.00
510	300595	欧普康视	100	3,019.00	0.00
511	002541	鸿路钢构	100	2,881.00	0.00
512	300900	广联航空	100	2,881.00	0.00
513	601677	明泰铝业	200	2,776.00	0.00
514	603633	徕木股份	200	2,614.00	0.00
515	600021	上海电力	200	2,154.00	0.00
516	000888	峨眉山 A	100	1,146.00	0.00
517	301256	华融化学	100	886.00	0.00
518	600320	振华重工	200	746.00	0.00
519	002027	分众传媒	100	681.00	0.00
520	688088	虹软科技	11	470.25	0.00
521	688186	广大特材	13	422.89	0.00

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688256	寒武纪	800	150,400.00	0.14
2	002185	华天科技	10,300	94,760.00	0.09
3	688099	晶晨股份	1,100	92,752.00	0.09
4	000021	深科技	3,700	73,963.00	0.07
5	605358	立昂微	2,000	73,460.00	0.07
6	300604	长川科技	1,500	71,235.00	0.07
7	688521	芯原股份	900	64,728.00	0.06

8	688002	睿创微纳	1,400	62,720.00	0.06
9	688385	复旦微电	1,100	55,110.00	0.05
10	300296	利亚德	8,200	53,546.00	0.05
11	603893	瑞芯微	700	50,995.00	0.05
12	603160	汇顶科技	1,100	50,875.00	0.05
13	000050	深天马 A	4,900	44,982.00	0.04
14	688538	和辉光电	16,800	42,672.00	0.04
15	600171	上海贝岭	2,300	41,975.00	0.04
16	300373	扬杰科技	1,000	40,570.00	0.04
17	688603	天承科技	591	32,505.00	0.03
18	600707	彩虹股份	5,900	28,084.00	0.03
19	688249	晶合集成	716	12,930.96	0.01
20	688772	珠海冠宇	500	10,075.00	0.01
21	688361	中科飞测	113	7,307.71	0.01
22	688443	智翔金泰	234	6,900.66	0.01
23	688469	中芯集成	1,270	6,870.70	0.01
24	688629	华丰科技	353	6,562.27	0.01
25	688478	晶升股份	137	5,804.69	0.01
26	688582	芯动联科	130	5,288.40	0.00
27	688562	航天软件	227	5,064.37	0.00
28	688576	西山科技	40	4,816.40	0.00
29	688620	安凯微	382	4,713.88	0.00
30	688146	中船特气	116	4,423.08	0.00
31	688352	硕中科技	355	4,284.85	0.00
32	688458	美芯晟	47	4,265.72	0.00
33	688334	西高院	260	4,214.60	0.00
34	688543	国科军工	79	4,190.95	0.00
35	688429	时创能源	149	3,803.97	0.00
36	688535	华海诚科	73	3,739.79	0.00
37	688512	慧智微	184	3,525.44	0.00
38	688570	天玛智控	139	3,520.87	0.00
39	688433	华曙高科	111	3,496.50	0.00
40	688631	莱斯信息	104	3,106.48	0.00
41	601061	中信金属	402	3,047.16	0.00
42	688623	双元科技	32	2,777.28	0.00
43	688479	友车科技	78	2,300.22	0.00
44	601133	柏诚股份	133	1,630.58	0.00
45	601065	江盐集团	136	1,610.24	0.00
46	603172	万丰股份	86	1,387.18	0.00
47	603125	常青科技	44	1,079.32	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002056	横店东磁	3,044,050.00	2.45
2	002244	滨江集团	2,610,072.00	2.10
3	300308	中际旭创	2,434,728.00	1.96
4	000513	丽珠集团	2,424,712.00	1.95
5	000999	华润三九	2,384,695.00	1.92
6	002831	裕同科技	2,208,252.00	1.78
7	300146	汤臣倍健	2,185,557.00	1.76
8	002625	光启技术	2,176,332.20	1.75
9	002422	科伦药业	2,148,727.06	1.73
10	000012	南玻 A	2,101,680.00	1.69
11	002372	伟星新材	2,078,820.00	1.67
12	002192	融捷股份	2,025,069.00	1.63
13	002384	东山精密	2,004,568.00	1.61
14	002250	联化科技	1,958,422.00	1.58
15	300888	稳健医疗	1,933,083.80	1.56
16	300009	安科生物	1,896,319.00	1.53
17	601699	潞安环能	1,892,633.90	1.52
18	300003	乐普医疗	1,882,702.00	1.52
19	002867	周大生	1,824,552.00	1.47
20	300832	新产业	1,789,404.00	1.44

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000999	华润三九	2,769,328.00	2.23
2	300308	中际旭创	2,646,663.00	2.13
3	002422	科伦药业	2,560,273.00	2.06
4	603444	吉比特	2,528,094.00	2.04
5	601699	潞安环能	2,523,682.00	2.03
6	002384	东山精密	2,501,251.00	2.01
7	002244	滨江集团	2,459,018.00	1.98
8	002831	裕同科技	2,452,370.00	1.98
9	000513	丽珠集团	2,415,351.00	1.95
10	002056	横店东磁	2,415,230.00	1.95
11	300363	博腾股份	2,410,643.00	1.94

12	002372	伟星新材	2,358,954.69	1.90
13	300390	天华新能	2,329,932.76	1.88
14	300724	捷佳伟创	2,318,379.00	1.87
15	000932	华菱钢铁	2,265,775.00	1.82
16	300073	当升科技	2,253,598.00	1.82
17	002192	融捷股份	2,244,407.00	1.81
18	300136	信维通信	2,225,776.00	1.79
19	002250	联化科技	2,186,296.00	1.76
20	300861	美畅股份	2,111,210.86	1.70

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	444,696,266.52
卖出股票收入（成交）总额	451,892,482.20

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,047,334.51
2	应收清算款	60,044.78
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	1,107,379.29

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,967	56,980.34	24,998,933.00	22.30%	87,081,400.00	77.70%

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	中信证券股份有限公司	4,674,700.00	4.17%
2	中信建投证券股份有限公司	3,138,700.00	2.80%
3	广东华兴玻璃股份有限公司	3,100,000.00	2.77%
4	招商证券股份有限公司	2,692,533.00	2.40%
5	杜爱明	2,473,000.00	2.21%
6	方正证券股份有限公司	2,063,500.00	1.84%
7	华泰证券股份有限公司	1,961,200.00	1.75%
8	马晓霞	1,910,900.00	1.70%
9	高璇	1,825,000.00	1.63%
10	黄时博	1,550,000.00	1.38%

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(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	162,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	187,500,000.00
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	112,080,333.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	405,078,751.74	45.26%	40,504.03	45.25%	-
兴业证券	1	337,915,687.93	37.75%	33,800.24	37.76%	-
海通证券	1	149,310,333.23	16.68%	14,932.79	16.68%	-
中信建投	1	2,749,202.23	0.31%	274.95	0.31%	-
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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	101,582.53	88.76%	-	-	-	-
兴业证券	12,867.03	11.24%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于旗下部分基金增加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、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-22
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	2023-04-15

		基金电子披露网站	
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

§ 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

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。

§ 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>