

# 深证成份交易型开放式指数证券投资 基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 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的法律责任。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 2024 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 2024 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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	49

7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	49
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12	投资组合报告附注	49
§8	基金份额持有人信息	50
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2	期末上市基金前十名持有人	50
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	51
§9	开放式基金份额变动	51
§10	重大事件揭示	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	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4	基金投资策略的改变	52
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8	其他重大事件	54
§11	影响投资者决策的其他重要信息	55
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	55
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	55
§12	备查文件目录	55
12.1	备查文件目录	55
12.2	存放地点	55
12.3	查阅方式	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方深证成份 ETF
场内简称	深成 ETF
基金主代码	159903
交易代码	159903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 4 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	352,154,507.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 2 月 2 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金为完全被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>存托凭证的投资策略：本基金将根据法律法规和监管机构的要求，制定存托凭证投资策略，关注发行人有关信息披露情况，关注发行人基本面情况、市场估值等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，参与存托凭证的投资，谨慎决定存托凭证的权重配置和标的选择。</p>
业绩比较基准	深证成份指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	常克川	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518017	100140
法定代表人		周易	廖林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-8,447,770.48
本期利润	-17,523,247.95
加权平均基金份额本期利润	-0.0528
本期加权平均净值利润率	-4.84%
本期基金份额净值增长率	-6.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-105,844,844.70
期末可供分配基金份额利润	-0.3006
期末基金资产净值	371,418,423.30

期末基金份额净值	1.0547
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-22.18%

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。

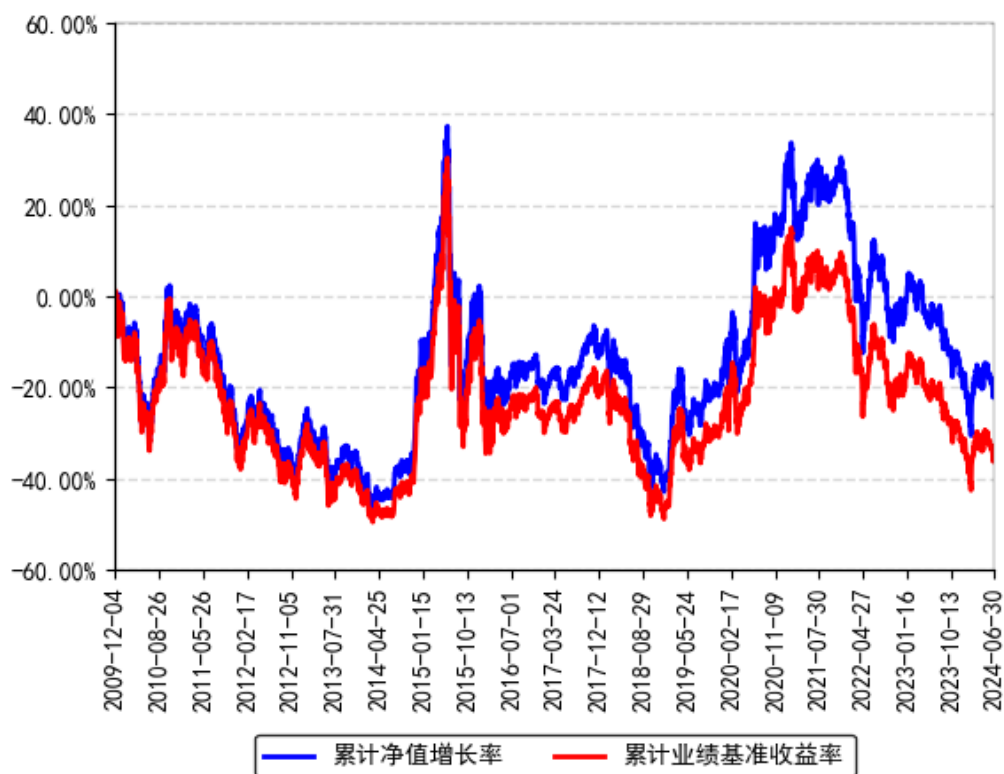
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-5.08%	0.86%	-5.51%	0.86%	0.43%	0.00%
过去三个月	-4.84%	1.10%	-5.87%	1.11%	1.03%	-0.01%
过去六个月	-6.23%	1.39%	-7.10%	1.40%	0.87%	-0.01%
过去一年	-18.89%	1.19%	-19.75%	1.19%	0.86%	0.00%
过去三年	-39.44%	1.23%	-41.64%	1.23%	2.20%	0.00%
自基金合同生效起至今	-22.18%	1.53%	-36.27%	1.54%	14.09%	-0.01%

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

南方深证成份ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。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	说明
----	----	-----------------	------	----



		任职日期	离任日期	年限	
孙伟	本基金基金经理	2016 年 8 月 19 日	-	14 年	北京大学工商管理硕士，特许金融分析师（CFA）、注册会计师（CPA），具有基金从业资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员、基金经理助理；2015 年 5 月 22 日至 2016 年 7 月 29 日，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月 2 日至 2020 年 12 月 1 日，任改革基金、高铁基金基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 7 日，任南方中证 500 工业 ETF 基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 14 日，任南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2020 年 12 月 1 日至 2021 年 4 月 19 日，任改革基金基金经理；2015 年 7 月 10 日至今，任 500 信息基金经理；2016 年 5 月 13 日至今，任南方创业板 ETF 基金经理；2016 年 5 月 20 日至今，任南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月 17 日至今，任 500 信息联接基金经理；2016 年 8 月 19 日至今，任深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月 8 日至今，任南方全指证券 ETF 联接基金经理；2017 年 3 月 10 日至今，任南方中证全指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月 28 日至今，任南方中证银行 ETF 基金经理；2017 年 6 月 29 日至今，任南方银行联接基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至今，任南方 H 股联接基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接基金经理；2020 年 12 月 1 日至今，任高铁基金基金经理；2022 年 3 月 3 日至今，任南方上海金 ETF 基金经理；2023 年 7 月 25 日至今，任南方上海金 ETF 发起联接基金经理。

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

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，两两组合同单日、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69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

2024年开年，A股市场延续了23年的下行趋势，并于2月初创出年内新低后企稳反弹。

经济方面，上半年国内经济保持总体平稳、稳中有进的良好态势，工业生产加速回暖，制造业投资回升，企业盈利修复，但依然存在有效需求不足和地产数据持续下滑的隐忧。

政策方面，发力点包括推动内需扩大、优化房地产政策、以及通过发行国债支持基础设施投资等，支持效应持续显现。

流动性方面，海外流动性迎来拐点，国内宏观流动性继续宽松且无风险利率持续下行，但资本市场总体缺少增量资金入市。

在A股生态环境变化和监管趋严的背景下，小微市值风格股票大幅下跌，大小盘市值风格走势分化显著，市场总体呈现较低风险偏好。

深证成指是反映深圳证券交易所市场整体表现的标尺性指数，深证成指报告期内下跌 7.10%。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

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

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；

(3) 根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内；

(4) 新股上市初期涨幅较大的影响。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0547 元，报告期内，份额净值增长率为-6.23%，同期业绩基准增长率为-7.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济结构将继续优化，服务业和消费对经济增长的贡献将持续加大，新质生产力将推动新产业、新业态的涌现和发展。

A 股资本市场有效性不断提升，机构化、国际化和长期化依然是未来长期发展趋势。

当前主要宽基指数的估值普遍处于历史低位，为长期配置提供了较佳的时间窗口。

虽然市场短期缺乏增量资金，但长期看，低利率时代下稳定高回报资产的稀缺，决定了未来居民在权益市场投资上巨大的增长潜力。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变

估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，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 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 中期财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	638,351.65	260,398.79
结算备付金		18,829.97	10,704.38
存出保证金		4,627.20	1,340.11
交易性金融资产	6.4.3.2	371,355,820.63	335,292,639.22
其中：股票投资		371,355,820.63	335,261,036.93
基金投资		-	-
债券投资		-	31,602.29
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		-	80,814.53
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		372,017,629.45	335,645,897.03
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		297,349.37	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		149,841.84	133,625.69
应付托管费		29,968.37	26,725.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.12
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	122,046.57	136,197.46
负债合计		599,206.15	296,548.42
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	477,263,268.00	404,078,867.51
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	-105,844,844.70	-68,729,518.90
净资产合计		371,418,423.30	335,349,348.61
负债和净资产总计		372,017,629.45	335,645,897.03

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0547 元，基金份额总额 352,154,507.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-16,285,371.37	3,921,884.30
1.利息收入		1,414.96	940.94
其中：存款利息收入	6.4.3.9	1,414.96	940.94
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,139,916.47	768,633.13
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-11,817,982.65	-1,823,823.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	4,686.74	24,382.46
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	-	-
股利收益	6.4.3.13	4,673,379.44	2,568,073.99
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	-9,075,477.47	3,152,903.93
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	-71,392.39	-593.70
减：二、营业总支出		1,237,876.58	913,318.93
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	902,575.17	632,353.68
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.6.2.2	180,515.03	126,470.69
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		0.02	-
8.其他费用	6.4.3.16	154,786.36	154,494.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-17,523,247.95	3,008,565.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-17,523,247.95	3,008,565.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-17,523,247.95	3,008,565.37

### 6.3 净资产变动表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	404,078,867.51	-	-68,729,518.90	335,349,348.61

资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	404,078,867.51	-	-68,729,518.90	335,349,348.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	73,184,400.49	-	-37,115,325.80	36,069,074.69
(一)、综合收益总额	-	-	-17,523,247.95	-17,523,247.95
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	73,184,400.49	-	-19,592,077.85	53,592,322.64
其中：1.基金申购款	182,961,001.25	-	-40,641,524.95	142,319,476.30
2.基金赎回款	-109,776,600.76	-	21,049,447.10	-88,727,153.66
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	477,263,268.00	-	-105,844,844.70	371,418,423.30
项目	上年度可比期间 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	257,710,066.47	-	-12,332,665.46	245,377,401.01
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	257,710,066.47	-	-12,332,665.46	245,377,401.01



三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	28,460,600.22	-	753,395.19	29,213,995.41
(一)、综合收益总额	-	-	3,008,565.37	3,008,565.37
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	28,460,600.22	-	-2,255,170.18	26,205,430.04
其中：1.基金申购款	52,855,400.39	-	-2,282,895.51	50,572,504.88
2.基金赎回款	-24,394,800.17	-	27,725.33	-24,367,074.84
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	286,170,666.69	-	-11,579,270.27	274,591,396.42

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

## 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	638,351.65
等于：本金	638,277.52
加：应计利息	74.13
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	638,351.65

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	420,533,335.39	-	371,355,820.63	-49,177,514.76
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	420,533,335.39	-	371,355,820.63	-49,177,514.76

#### 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 2024 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	2,511.21
其中：交易所市场	2,511.21
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	84,535.36
应付指数使用费	35,000.00
可退替代款	-
合计	122,046.57

### 6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	298,154,507.00	404,078,867.51
本期申购	135,000,000.00	182,961,001.25
本期赎回（以“-”号填列）	-81,000,000.00	-109,776,600.76
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	352,154,507.00	477,263,268.00

注：红利再投及转入份额计入本期申购，转出份额计入本期赎回。

### 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	213,405,566.65	-282,135,085.55	-68,729,518.90
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	213,405,566.65	-282,135,085.55	-68,729,518.90
本期利润	-8,447,770.48	-9,075,477.47	-17,523,247.95
本期基金份额交易产生的变动数	38,132,010.49	-57,724,088.34	-19,592,077.85
其中：基金申购款	94,604,417.95	-135,245,942.90	-40,641,524.95
基金赎回款	-56,472,407.46	77,521,854.56	21,049,447.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	243,089,806.66	-348,934,651.36	-105,844,844.70

### 6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,119.83
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	266.18
其他	28.95
合计	1,414.96

### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,042,425.70
股票投资收益——赎回差价收入	-8,775,556.95
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	-11,817,982.65

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	12,287,787.40

减：卖出股票成本总额	15,317,773.59
减：交易费用	12,439.51
买卖股票差价收入	-3,042,425.70

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	88,727,153.66
减：现金支付赎回款总额	-30,989.34
减：赎回股票成本总额	97,533,699.95
减：交易费用	-
赎回差价收入	-8,775,556.95

#### 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。

#### 6.4.3.11 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	3.75
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,682.99
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	4,686.74

##### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	36,290.67
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	31,600.00
减：应计利息总额	6.23
减：交易费用	1.45
买卖债券差价收入	4,682.99

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**

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

**6.4.3.13 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,673,379.44
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	4,673,379.44

**6.4.3.14 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-9,075,477.47
——股票投资	-9,075,477.47
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-9,075,477.47

**6.4.3.15 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-71,392.39
合计	-71,392.39

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

### 6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00
银行费用	251.00
合计	154,786.36

## 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

## 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
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金("南方深成 ETF 联接基金")	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	6,242,808.74	16.28%	-	-

#### 6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	36,290.67	100.00%	-	-

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	624.38	16.28%	12.90	0.51%
关联方名称	上年度可比期间 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	-	-	-	-

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符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告〔2024〕3号）相关规定。《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》生效后，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	902,575.17	632,353.68
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的	902,575.17	632,353.68



净管理费		
------	--	--

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 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	180,515.03	126,470.69

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

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

#### 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	780,009.00	0.22%	780,020.00	0.26%
中国工商银行股份有限公司-南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	152,764,174.00	43.38%	138,826,474.00	46.56%

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

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	638,351.65	1,119.83	874,592.88	834.91

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	127084	柳工转 2	配债	327	32,700.00

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 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（2024 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

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
400174	中天3	2023年8月30日	暂停转让	0.14	尚未复牌	-	100,100	332,602.15	14,014.00	-

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.9 金融工具风险及管理

#### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪深证成份指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

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

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

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

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

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

##### 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

限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

#### 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。

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

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	638,351.65	-	-	-	638,351.65

结算备付金	18,829.97	-	-	-	18,829.97
存出保证金	4,627.20	-	-	-	4,627.20
交易性金融资产	-	-	-	371,355,820.63	371,355,820.63
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	661,808.82	-	-	371,355,820.63	372,017,629.45
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	-	-	-	297,349.37	297,349.37
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	149,841.84	149,841.84
应付托管费	-	-	-	29,968.37	29,968.37
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	-	-	-	122,046.57	122,046.57

负债总计	-	-	-	599,206.15	599,206.15
利率敏感度缺口	661,808.82	-	-	370,756,614.48	371,418,423.30
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	260,398.79	-	-	-	260,398.79
结算备付金	10,704.38	-	-	-	10,704.38
存出保证金	1,340.11	-	-	-	1,340.11
交易性金融资产	-	-	31,602.29	335,261,036.93	335,292,639.22
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	-	-	-	80,814.53	80,814.53
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	272,443.28	-	31,602.29	335,341,851.46	335,645,897.03
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	133,625.69	133,625.69
应付托管费	-	-	-	26,725.15	26,725.15
应付销售服	-	-	-	-	-

务费					
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.12	0.12
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	136,197.46	136,197.46
负债总计	-	-	-	296,548.42	296,548.42
利率敏感度缺口	272,443.28	-	31,602.29	335,045,303.04	335,349,348.61

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（2024年6月30日）	上年度末（2023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和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，深证成份指数成份股和备选成份股股票以及存托凭证投资比例不低于基金资产净值的95%，新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例不高于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。



## 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	371,355,820.63	99.98	335,261,036.93	99.97
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	371,355,820.63	99.98	335,261,036.93	99.97

## 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	18,456,597.02	16,669,402.27
	2.组合自身基准下降 5%	-18,456,597.02	-16,669,402.27

## 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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	371,341,806.63
第二层次	-
第三层次	14,014.00

合计	371,355,820.63
----	----------------

#### 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，确定相关金融工具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

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	371,355,820.63	99.82
	其中：股票	371,355,820.63	99.82
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	657,181.62	0.18
8	其他各项资产	4,627.20	0.00

9	合计	372,017,629.45	100.00
---	----	----------------	--------

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而行业分类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

金额单位：人民币元

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	9,426,535.18	2.54
B	采矿业	6,571,536.36	1.77
C	制造业	279,082,594.79	75.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,879,766.00	1.58
E	建筑业	558,984.78	0.15
F	批发和零售业	3,099,682.15	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	5,473,088.41	1.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,461,625.92	5.24
J	金融业	25,169,172.58	6.78
K	房地产业	3,701,493.28	1.00
L	租赁和商务服务业	3,968,948.81	1.07
M	科学研究和技术服务业	2,846,351.50	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	868,173.16	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	282,897.00	0.08
Q	卫生和社会工作	2,610,903.84	0.70
R	文化、体育和娱乐业	2,340,052.87	0.63
S	综合	-	-
	合计	371,341,806.63	99.98

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	14,014.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,014.00	0.00

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	99,380	17,891,381.40	4.82
2	000333	美的集团	188,042	12,128,709.00	3.27
3	000858	五粮液	70,441	9,019,265.64	2.43
4	002594	比亚迪	32,936	8,242,234.00	2.22
5	002475	立讯精密	178,308	7,009,287.48	1.89
6	000651	格力电器	172,240	6,755,252.80	1.82
7	300760	迈瑞医疗	20,500	5,963,655.00	1.61
8	300059	东方财富	484,281	5,114,007.36	1.38
9	000725	京东方 A	1,230,442	5,032,507.78	1.35
10	300308	中际旭创	33,564	4,627,804.32	1.25
11	002415	海康威视	146,381	4,524,636.71	1.22
12	002714	牧原股份	96,603	4,211,890.80	1.13
13	000568	泸州老窖	28,992	4,160,062.08	1.12
14	300498	温氏股份	209,709	4,156,432.38	1.12
15	300124	汇川技术	74,691	3,831,648.30	1.03
16	002371	北方华创	10,800	3,454,812.00	0.93
17	000063	中兴通讯	123,433	3,452,421.01	0.93
18	300274	阳光电源	55,249	3,427,095.47	0.92

19	000001	平安银行	328,312	3,332,366.80	0.90
20	000338	潍柴动力	196,908	3,197,785.92	0.86
21	002230	科大讯飞	71,970	3,091,111.50	0.83
22	002352	顺丰控股	85,583	3,054,457.27	0.82
23	000100	TCL 科技	704,378	3,042,912.96	0.82
24	002142	宁波银行	132,611	2,925,398.66	0.79
25	000792	盐湖股份	150,200	2,620,990.00	0.71
26	300502	新易盛	24,147	2,548,715.85	0.69
27	002027	分众传媒	391,596	2,373,071.76	0.64
28	000625	长安汽车	166,436	2,235,235.48	0.60
29	000425	徐工机械	297,008	2,123,607.20	0.57
30	300014	亿纬锂能	48,851	1,950,131.92	0.53
31	002463	沪电股份	51,920	1,895,080.00	0.51
32	002304	洋河股份	23,161	1,870,019.14	0.50
33	002241	歌尔股份	94,610	1,845,841.10	0.50
34	300015	爱尔眼科	167,188	1,725,380.16	0.46
35	000002	万科 A	237,958	1,649,048.94	0.44
36	002179	中航光电	43,086	1,639,422.30	0.44
37	002050	三花智控	80,060	1,527,544.80	0.41
38	000538	云南白药	29,720	1,520,178.00	0.41
39	000938	紫光股份	67,358	1,505,451.30	0.41
40	000166	申万宏源	342,369	1,475,610.39	0.40
41	000977	浪潮信息	40,286	1,465,201.82	0.39
42	002028	思源电气	21,900	1,465,110.00	0.39
43	002311	海大集团	30,240	1,422,792.00	0.38
44	300408	三环集团	48,700	1,421,553.00	0.38
45	002252	上海莱士	179,840	1,406,348.80	0.38
46	300433	蓝思科技	75,158	1,371,633.50	0.37
47	002422	科伦药业	45,078	1,367,215.74	0.37
48	000776	广发证券	109,859	1,336,984.03	0.36
49	000157	中联重科	173,727	1,334,223.36	0.36
50	002049	紫光国微	25,278	1,329,622.80	0.36
51	003816	中国广核	270,800	1,253,804.00	0.34
52	300122	智飞生物	43,950	1,231,918.50	0.33
53	002460	赣锋锂业	42,760	1,225,074.00	0.33
54	002648	卫星化学	67,201	1,208,273.98	0.33
55	000933	神火股份	59,700	1,207,731.00	0.33
56	000768	中航西飞	50,190	1,206,065.70	0.32
57	002466	天齐锂业	39,900	1,193,409.00	0.32
58	002340	格林美	187,300	1,193,101.00	0.32
59	001979	招商蛇口	133,027	1,169,307.33	0.31
60	000596	古井贡酒	5,539	1,169,116.73	0.31
61	002001	新和成	59,728	1,146,777.60	0.31

62	002236	大华股份	72,778	1,125,147.88	0.30
63	002601	龙佰集团	60,300	1,119,771.00	0.30
64	002493	荣盛石化	115,625	1,116,937.50	0.30
65	000423	东阿阿胶	17,505	1,095,813.00	0.30
66	000807	云铝股份	80,800	1,091,608.00	0.29
67	000661	长春高新	11,700	1,073,709.00	0.29
68	000786	北新建材	35,400	1,049,964.00	0.28
69	000975	山金国际	63,904	1,040,996.16	0.28
70	300394	天孚通信	11,760	1,039,819.20	0.28
71	300418	昆仑万维	32,200	1,038,128.00	0.28
72	002384	东山精密	49,300	1,020,510.00	0.27
73	300782	卓胜微	13,086	1,017,305.64	0.27
74	000983	山西焦煤	97,520	1,005,431.20	0.27
75	300347	泰格医药	20,600	1,001,160.00	0.27
76	002129	TCL 中环	113,900	985,235.00	0.27
77	000895	双汇发展	41,324	982,271.48	0.26
78	002938	鹏鼎控股	24,700	982,072.00	0.26
79	300661	圣邦股份	11,836	979,784.08	0.26
80	000988	华工科技	32,700	978,711.00	0.26
81	000630	铜陵有色	268,800	970,368.00	0.26
82	002180	纳思达	36,200	956,404.00	0.26
83	002156	通富微电	41,980	939,932.20	0.25
84	002271	东方雨虹	76,163	939,851.42	0.25
85	002625	光启技术	53,690	931,521.50	0.25
86	300896	爱美客	5,380	925,898.00	0.25
87	002736	国信证券	106,200	922,878.00	0.25
88	002966	苏州银行	117,980	884,850.00	0.24
89	002223	鱼跃医疗	23,200	872,320.00	0.23
90	000400	许继电气	25,000	860,250.00	0.23
91	002456	欧菲光	110,002	859,115.62	0.23
92	002078	太阳纸业	60,900	849,555.00	0.23
93	002920	德赛西威	9,700	844,773.00	0.23
94	300832	新产业	12,500	843,000.00	0.23
95	000963	华东医药	29,495	820,255.95	0.22
96	002709	天赐材料	46,356	814,011.36	0.22
97	002353	杰瑞股份	23,187	813,399.96	0.22
98	002185	华天科技	99,774	813,158.10	0.22
99	300207	欣旺达	53,400	810,078.00	0.22
100	300573	兴齐眼药	4,920	806,880.00	0.22
101	002532	天山铝业	99,200	804,512.00	0.22
102	002128	电投能源	38,100	803,910.00	0.22
103	002074	国轩高科	41,900	802,385.00	0.22
104	000999	华润三九	18,780	799,652.40	0.22

105	300033	同花顺	7,700	798,490.00	0.21
106	002273	水晶光电	46,554	790,486.92	0.21
107	002459	晶澳科技	69,876	782,611.20	0.21
108	002916	深南电路	7,392	781,851.84	0.21
109	002600	领益智造	109,200	777,504.00	0.21
110	301236	软通动力	21,950	772,859.50	0.21
111	002602	世纪华通	225,251	772,610.93	0.21
112	000301	东方盛虹	96,300	767,511.00	0.21
113	000876	新希望	82,552	754,525.28	0.20
114	002797	第一创业	147,540	750,978.60	0.20
115	002465	海格通信	72,200	747,992.00	0.20
116	002555	三七互娱	56,900	742,545.00	0.20
117	002138	顺络电子	26,700	733,182.00	0.20
118	300476	胜宏科技	22,700	732,302.00	0.20
119	300142	沃森生物	63,000	716,940.00	0.19
120	300003	乐普医疗	47,500	704,900.00	0.19
121	002281	光迅科技	18,700	698,819.00	0.19
122	001965	招商公路	58,700	696,182.00	0.19
123	000408	藏格矿业	28,900	695,623.00	0.19
124	000932	华菱钢铁	156,340	692,586.20	0.19
125	000683	远兴能源	99,000	684,090.00	0.18
126	000831	中国稀土	26,900	681,915.00	0.18
127	300316	晶盛机电	23,710	681,188.30	0.18
128	002202	金风科技	101,313	680,823.36	0.18
129	000878	云南铜业	54,596	680,266.16	0.18
130	000066	中国长城	77,738	680,207.50	0.18
131	300751	迈为股份	5,658	676,017.84	0.18
132	002409	雅克科技	10,700	673,137.00	0.18
133	300759	康龙化成	35,925	667,486.50	0.18
134	002444	巨星科技	27,000	666,900.00	0.18
135	002738	中矿资源	24,780	664,104.00	0.18
136	002008	大族激光	31,900	663,520.00	0.18
137	000039	中集集团	71,490	661,997.40	0.18
138	002517	恺英网络	69,100	659,905.00	0.18
139	300628	亿联网络	17,700	650,829.00	0.18
140	000733	振华科技	15,500	643,715.00	0.17
141	000426	兴业银锡	47,000	638,260.00	0.17
142	000528	柳工	56,860	636,263.40	0.17
143	300450	先导智能	37,899	630,260.37	0.17
144	300017	网宿科技	79,145	625,245.50	0.17
145	000728	国元证券	103,005	624,210.30	0.17
146	002007	华兰生物	39,330	621,020.70	0.17
147	300496	中科创达	13,454	613,367.86	0.17

148	300136	信维通信	31,260	612,070.80	0.16
149	300339	润和软件	29,600	611,832.00	0.16
150	300223	北京君正	10,900	604,296.00	0.16
151	002812	恩捷股份	19,080	603,882.00	0.16
152	300054	鼎龙股份	26,500	601,020.00	0.16
153	002595	豪迈科技	15,700	599,269.00	0.16
154	300999	金龙鱼	21,858	597,816.30	0.16
155	002436	兴森科技	57,900	597,528.00	0.16
156	002673	西部证券	95,254	589,622.26	0.16
157	002085	万丰奥威	44,528	589,550.72	0.16
158	300002	神州泰岳	71,500	580,580.00	0.16
159	300474	景嘉微	9,150	578,554.50	0.16
160	300866	安克创新	8,110	577,513.10	0.16
161	000960	锡业股份	37,200	576,228.00	0.16
162	002739	万达电影	47,500	574,275.00	0.15
163	000783	长江证券	118,119	570,514.77	0.15
164	000021	深科技	37,600	568,512.00	0.15
165	002155	湖南黄金	31,400	568,340.00	0.15
166	002318	久立特材	24,200	564,586.00	0.15
167	300001	特锐德	27,800	559,336.00	0.15
168	002472	双环传动	25,400	559,308.00	0.15
169	002821	凯莱英	8,480	557,984.00	0.15
170	300012	华测检测	54,400	547,264.00	0.15
171	000703	恒逸石化	76,578	542,938.02	0.15
172	300285	国瓷材料	30,350	541,747.50	0.15
173	000513	丽珠集团	14,460	538,056.60	0.14
174	000617	中油资本	97,000	535,440.00	0.14
175	300073	当升科技	15,600	535,236.00	0.14
176	300037	新宙邦	18,660	532,929.60	0.14
177	000738	航发控制	26,550	532,858.50	0.14
178	301269	华大九天	6,900	531,645.00	0.14
179	000009	中国宝安	61,617	529,906.20	0.14
180	002405	四维图新	84,596	526,187.12	0.14
181	002152	广电运通	49,900	521,954.00	0.14
182	300058	蓝色光标	95,934	521,880.96	0.14
183	300146	汤臣倍健	38,300	518,965.00	0.14
184	300724	捷佳伟创	9,600	518,496.00	0.14
185	002850	科达利	6,700	511,746.00	0.14
186	002195	岩山科技	203,505	510,797.55	0.14
187	002410	广联达	53,247	510,106.26	0.14
188	000723	美锦能源	106,600	507,416.00	0.14
189	000766	通化金马	31,200	505,128.00	0.14
190	300395	菲利华	16,400	504,300.00	0.14



191	300699	光威复材	20,292	503,850.36	0.14
192	300346	南大光电	17,590	502,898.10	0.14
193	002984	森麒麟	20,860	502,517.40	0.14
194	300413	芒果超媒	24,000	501,600.00	0.14
195	300919	中伟股份	16,160	500,798.40	0.13
196	000921	海信家电	15,500	499,720.00	0.13
197	300114	中航电测	11,000	497,750.00	0.13
198	002407	多氟多	40,660	497,271.80	0.13
199	300144	宋城演艺	61,926	497,265.78	0.13
200	002262	恩华药业	20,900	496,166.00	0.13
201	002025	航天电器	10,690	495,802.20	0.13
202	002294	信立泰	18,600	495,318.00	0.13
203	300364	中文在线	22,500	485,550.00	0.13
204	301358	湖南裕能	15,400	484,484.00	0.13
205	000591	太阳能	102,700	483,717.00	0.13
206	002176	江特电机	58,900	480,035.00	0.13
207	002064	华峰化学	66,200	474,654.00	0.13
208	000519	中兵红箭	32,300	473,841.00	0.13
209	002385	大北农	122,850	472,972.50	0.13
210	000403	派林生物	17,700	471,882.00	0.13
211	000750	国海证券	161,525	470,037.75	0.13
212	300251	光线传媒	55,620	467,764.20	0.13
213	000623	吉林敖东	34,818	466,561.20	0.13
214	300529	健帆生物	17,100	465,291.00	0.13
215	300454	深信服	9,200	464,876.00	0.13
216	002603	以岭药业	30,320	464,805.60	0.13
217	002558	巨人网络	48,800	460,672.00	0.12
218	002439	启明星辰	26,500	457,390.00	0.12
219	000830	鲁西化工	39,100	453,169.00	0.12
220	300383	光环新网	53,100	448,695.00	0.12
221	000708	中信特钢	32,830	445,503.10	0.12
222	002958	青农商行	165,700	444,076.00	0.12
223	000818	航锦科技	20,100	443,808.00	0.12
224	300677	英科医疗	16,520	442,901.20	0.12
225	300024	机器人	44,790	436,254.60	0.12
226	300373	扬杰科技	11,160	434,124.00	0.12
227	002756	永兴材料	12,120	433,653.60	0.12
228	002044	美年健康	113,056	427,351.68	0.12
229	300604	长川科技	15,500	421,135.00	0.11
230	000034	神州数码	18,300	418,887.00	0.11
231	000629	钒钛股份	167,200	418,000.00	0.11
232	300118	东方日升	34,400	416,240.00	0.11
233	300458	全志科技	17,692	415,938.92	0.11

234	000883	湖北能源	68,400	411,084.00	0.11
235	002841	视源股份	13,900	410,467.00	0.11
236	300775	三角防务	13,400	410,040.00	0.11
237	000060	中金岭南	96,645	409,774.80	0.11
238	300567	精测电子	7,250	409,697.50	0.11
239	000729	燕京啤酒	46,200	407,946.00	0.11
240	300679	电连技术	10,100	406,323.00	0.11
241	300253	卫宁健康	68,423	403,695.70	0.11
242	002429	兆驰股份	83,800	403,078.00	0.11
243	300442	润泽科技	16,800	402,360.00	0.11
244	000997	新大陆	28,880	401,720.80	0.11
245	300487	蓝晓科技	9,600	400,896.00	0.11
246	002430	杭氧股份	18,000	400,500.00	0.11
247	300294	博雅生物	12,050	397,650.00	0.11
248	000875	吉电股份	74,100	394,953.00	0.11
249	000799	酒鬼酒	9,000	394,830.00	0.11
250	002508	老板电器	17,860	394,706.00	0.11
251	002120	韵达股份	50,761	392,890.14	0.11
252	300390	天华新能	22,800	391,704.00	0.11
253	000636	风华高科	29,900	390,494.00	0.11
254	002056	横店东磁	31,200	389,064.00	0.10
255	300568	星源材质	47,027	385,621.40	0.10
256	000887	中鼎股份	31,400	384,336.00	0.10
257	300633	开立医疗	9,700	383,926.00	0.10
258	000998	隆平高科	38,800	381,404.00	0.10
259	000598	兴蓉环境	50,400	379,008.00	0.10
260	002831	裕同科技	14,780	378,220.20	0.10
261	002372	伟星新材	24,220	373,472.40	0.10
262	300088	长信科技	79,104	371,788.80	0.10
263	002837	英维克	17,380	371,758.20	0.10
264	300601	康泰生物	23,800	371,518.00	0.10
265	002624	完美世界	48,850	371,260.00	0.10
266	002926	华西证券	56,300	371,017.00	0.10
267	002065	东华软件	81,800	369,736.00	0.10
268	300009	安科生物	43,267	369,500.18	0.10
269	002414	高德红外	62,520	368,242.80	0.10
270	002851	麦格米特	14,200	366,928.00	0.10
271	002936	郑州银行	211,440	365,791.20	0.10
272	300765	新诺威	14,460	364,825.80	0.10
273	300115	长盈精密	30,388	364,352.12	0.10
274	002373	千方科技	40,100	363,707.00	0.10
275	000690	宝新能源	71,200	363,120.00	0.10
276	002151	北斗星通	15,000	362,700.00	0.10

277	002507	涪陵榨菜	29,440	360,640.00	0.10
278	300979	华利集团	5,900	359,015.00	0.10
279	000422	湖北宜化	30,100	358,792.00	0.10
280	300763	锦浪科技	8,565	356,646.60	0.10
281	002497	雅化集团	39,700	354,124.00	0.10
282	002368	太极股份	15,659	353,110.45	0.10
283	300296	利亚德	78,350	352,575.00	0.09
284	300459	汤姆猫	103,989	352,522.71	0.09
285	002500	山西证券	74,880	351,936.00	0.09
286	002240	盛新锂能	26,200	351,604.00	0.09
287	002487	大金重工	15,300	350,064.00	0.09
288	002019	亿帆医药	28,300	349,788.00	0.09
289	000543	皖能电力	39,500	349,575.00	0.09
290	300803	指南针	9,600	349,536.00	0.09
291	000027	深圳能源	47,840	349,232.00	0.09
292	002203	海亮股份	43,400	346,332.00	0.09
293	002080	中材科技	26,810	345,849.00	0.09
294	002568	百润股份	20,500	345,015.00	0.09
295	002683	广东宏大	17,100	344,223.00	0.09
296	001286	陕西能源	29,700	342,441.00	0.09
297	002939	长城证券	51,100	342,370.00	0.09
298	002389	航天彩虹	24,600	341,694.00	0.09
299	301308	江波龙	3,600	341,064.00	0.09
300	002145	中核钛白	103,685	340,086.80	0.09
301	000893	亚钾国际	20,900	337,744.00	0.09
302	000155	川能动力	31,200	336,024.00	0.09
303	300666	江丰电子	7,000	332,920.00	0.09
304	000778	新兴铸管	95,432	332,103.36	0.09
305	002402	和而泰	31,000	332,010.00	0.09
306	000951	中国重汽	23,140	331,364.80	0.09
307	002572	索菲亚	21,564	330,576.12	0.09
308	002557	洽洽食品	11,700	329,823.00	0.09
309	000581	威孚高科	20,251	329,686.28	0.09
310	300070	碧水源	78,434	328,638.46	0.09
311	000050	深天马 A	44,700	325,416.00	0.09
312	002506	协鑫集成	166,600	323,204.00	0.09
313	002131	利欧股份	223,843	320,095.49	0.09
314	000563	陕国投 A	116,130	319,357.50	0.09
315	002299	圣农发展	23,400	319,176.00	0.09
316	300558	贝达药业	9,800	318,990.00	0.09
317	300676	华大基因	9,100	318,591.00	0.09
318	301301	川宁生物	24,800	316,944.00	0.09
319	002531	天顺风能	35,400	316,476.00	0.09

320	300182	捷成股份	84,959	315,197.89	0.08
321	002268	电科网安	22,000	313,060.00	0.08
322	300735	光弘科技	14,400	311,040.00	0.08
323	000739	普洛药业	22,800	309,396.00	0.08
324	002221	东华能源	37,600	308,696.00	0.08
325	002832	比音勒芬	12,700	306,959.00	0.08
326	300212	易华录	18,200	306,306.00	0.08
327	300456	赛微电子	19,100	303,117.00	0.08
328	300298	三诺生物	11,900	301,546.00	0.08
329	300748	金力永磁	23,260	301,449.60	0.08
330	000686	东北证券	54,000	301,320.00	0.08
331	000762	西藏矿业	16,600	300,128.00	0.08
332	002244	滨江集团	41,200	299,112.00	0.08
333	300638	广和通	17,460	298,566.00	0.08
334	002317	众生药业	26,000	297,180.00	0.08
335	300595	欧普康视	18,920	296,665.60	0.08
336	002249	大洋电机	62,534	295,785.82	0.08
337	002653	海思科	9,600	294,720.00	0.08
338	000547	航天发展	50,200	294,172.00	0.08
339	002675	东诚药业	23,800	291,788.00	0.08
340	000709	河钢股份	150,400	291,776.00	0.08
341	000877	天山股份	54,000	291,600.00	0.08
342	002745	木林森	36,100	290,966.00	0.08
343	300034	钢研高纳	18,280	290,469.20	0.08
344	300777	中简科技	13,500	290,250.00	0.08
345	002245	蔚蓝锂芯	37,400	289,850.00	0.08
346	300475	香农芯创	9,800	289,786.00	0.08
347	000035	中国天楹	63,900	289,467.00	0.08
348	000069	华侨城 A	141,849	289,371.96	0.08
349	002747	埃斯顿	20,300	288,666.00	0.08
350	002701	奥瑞金	68,900	286,624.00	0.08
351	300229	拓尔思	21,300	286,059.00	0.08
352	000825	太钢不锈	84,100	284,258.00	0.08
353	002607	中公教育	184,900	282,897.00	0.08
354	000970	中科三环	36,970	282,820.50	0.08
355	002617	露笑科技	58,400	280,320.00	0.08
356	300672	国科微	5,300	280,052.00	0.08
357	002698	博实股份	22,600	277,302.00	0.07
358	002773	康弘药业	12,790	276,903.50	0.07
359	002312	川发龙蟒	40,900	275,257.00	0.07
360	002408	齐翔腾达	48,620	272,272.00	0.07
361	000937	冀中能源	40,400	270,680.00	0.07
362	002015	协鑫能科	33,900	269,844.00	0.07

363	002032	苏泊尔	5,300	265,530.00	0.07
364	000902	新洋丰	22,302	264,724.74	0.07
365	300623	捷捷微电	15,300	264,690.00	0.07
366	001227	兰州银行	111,100	264,418.00	0.07
367	002484	江海股份	19,600	259,700.00	0.07
368	300438	鹏辉能源	13,900	254,926.00	0.07
369	003031	中瓷电子	5,500	254,320.00	0.07
370	002948	青岛银行	74,790	252,042.30	0.07
371	002597	金禾实业	12,600	250,614.00	0.07
372	002266	浙富控股	89,630	250,067.70	0.07
373	002091	江苏国泰	36,700	249,927.00	0.07
374	002237	恒邦股份	21,500	247,465.00	0.07
375	300026	红日药业	80,800	246,440.00	0.07
376	300957	贝泰妮	5,100	246,432.00	0.07
377	002541	鸿路钢构	14,500	246,065.00	0.07
378	000800	一汽解放	31,300	245,079.00	0.07
379	300910	瑞丰新材	5,600	244,832.00	0.07
380	300761	立华股份	10,800	244,512.00	0.07
381	300773	拉卡拉	19,600	243,628.00	0.07
382	000032	深桑达 A	16,200	242,676.00	0.07
383	300457	赢合科技	13,600	242,488.00	0.07
384	300482	万孚生物	9,930	242,292.00	0.07
385	000012	南玻 A	47,846	241,143.84	0.06
386	300776	帝尔激光	5,123	235,453.08	0.06
387	002192	融捷股份	7,800	234,156.00	0.06
388	002048	宁波华翔	18,000	232,920.00	0.06
389	300674	宇信科技	20,900	231,572.00	0.06
390	301050	雷电微力	4,800	231,168.00	0.06
391	300769	德方纳米	8,184	230,788.80	0.06
392	002396	星网锐捷	17,200	227,212.00	0.06
393	000089	深圳机场	35,500	226,845.00	0.06
394	000156	华数传媒	35,900	225,452.00	0.06
395	002906	华阳集团	8,400	224,784.00	0.06
396	300244	迪安诊断	18,196	218,352.00	0.06
397	000028	国药一致	6,730	216,907.90	0.06
398	300357	我武生物	10,640	215,140.80	0.06
399	002423	中粮资本	28,600	214,214.00	0.06
400	000987	越秀资本	43,186	214,202.56	0.06
401	000559	万向钱潮	47,840	213,366.40	0.06
402	300747	锐科激光	12,010	213,177.50	0.06
403	002643	万润股份	21,250	212,500.00	0.06
404	002212	天融信	43,600	212,332.00	0.06
405	002865	钧达股份	5,497	210,974.86	0.06

406	002867	周大生	15,925	207,980.50	0.06
407	000429	粤高速 A	19,700	205,077.00	0.06
408	002468	申通快递	24,100	202,440.00	0.05
409	301039	中集车辆	23,500	202,100.00	0.05
410	002326	永太科技	25,700	200,974.00	0.05
411	002099	海翔药业	39,200	200,312.00	0.05
412	000555	神州信息	21,400	199,448.00	0.05
413	002690	美亚光电	11,989	197,818.50	0.05
414	000785	居然之家	81,100	197,073.00	0.05
415	002254	泰和新材	22,200	196,470.00	0.05
416	002183	怡亚通	68,440	194,369.60	0.05
417	002030	达安基因	38,581	192,905.00	0.05
418	000552	甘肃能化	55,300	191,891.00	0.05
419	002727	一心堂	12,600	190,134.00	0.05
420	002608	江苏国信	24,000	186,000.00	0.05
421	300888	稳健医疗	7,280	184,184.00	0.05
422	002670	国盛金控	21,660	183,460.20	0.05
423	300682	朗新集团	21,550	183,390.50	0.05
424	000927	中国铁物	76,300	181,594.00	0.05
425	300432	富临精工	28,100	180,964.00	0.05
426	002010	传化智联	47,100	180,864.00	0.05
427	003035	南网能源	40,900	179,960.00	0.05
428	000958	电投产融	49,000	179,340.00	0.05
429	000898	鞍钢股份	84,369	178,862.28	0.05
430	002153	石基信息	31,098	178,191.54	0.05
431	300171	东富龙	14,900	177,161.00	0.05
432	000810	创维数字	20,600	176,748.00	0.05
433	002511	中顺洁柔	25,200	174,384.00	0.05
434	001872	招商港口	9,000	173,250.00	0.05
435	000967	盈峰环境	40,800	172,584.00	0.05
436	000537	中绿电	17,900	170,587.00	0.05
437	003022	联泓新科	12,300	168,633.00	0.05
438	000539	粤电力 A	32,800	166,624.00	0.04
439	000930	中粮科技	32,900	165,487.00	0.04
440	002563	森马服饰	28,400	165,004.00	0.04
441	301219	腾远钴业	4,300	164,518.00	0.04
442	002081	金螳螂	53,826	163,092.78	0.04
443	300376	ST 易事特	40,000	160,400.00	0.04
444	301035	润丰股份	3,600	160,344.00	0.04
445	001914	招商积余	16,000	160,320.00	0.04
446	000401	冀东水泥	39,264	159,411.84	0.04
447	002518	科士达	9,000	159,300.00	0.04
448	002705	新宝股份	11,300	158,991.00	0.04

449	001203	大中矿业	16,200	155,682.00	0.04
450	300363	博腾股份	12,900	154,155.00	0.04
451	002060	广东建工	44,800	153,216.00	0.04
452	300257	开山股份	15,100	152,510.00	0.04
453	300428	立中集团	8,200	152,438.00	0.04
454	000966	长源电力	34,300	151,263.00	0.04
455	001287	中电港	9,100	150,423.00	0.04
456	002985	北摩高科	6,751	148,724.53	0.04
457	002498	汉缆股份	44,800	147,392.00	0.04
458	301095	广立微	3,500	143,920.00	0.04
459	000959	首钢股份	52,500	142,800.00	0.04
460	000582	北部湾港	19,100	142,104.00	0.04
461	301267	华夏眼科	6,800	140,896.00	0.04
462	301155	海力风电	3,400	136,782.00	0.04
463	002216	三全食品	12,440	136,591.20	0.04
464	000402	金融街	57,163	134,333.05	0.04
465	000088	盐田港	29,400	133,182.00	0.04
466	002925	盈趣科技	10,430	132,148.10	0.04
467	301047	义翘神州	2,200	131,890.00	0.04
468	301029	怡合达	6,572	129,205.52	0.03
469	301238	瑞泰新材	8,600	128,742.00	0.03
470	002320	海峡股份	24,225	125,001.00	0.03
471	001213	中铁特货	30,800	121,660.00	0.03
472	002110	三钢闽光	40,850	120,507.50	0.03
473	002791	坚朗五金	4,600	119,002.00	0.03
474	300861	美畅股份	6,120	118,422.00	0.03
475	000627	天茂集团	67,000	117,250.00	0.03
476	300726	宏达电子	5,100	116,280.00	0.03
477	000935	四川双马	9,500	114,095.00	0.03
478	002041	登海种业	14,000	113,120.00	0.03
479	300850	新强联	7,500	112,650.00	0.03
480	002945	华林证券	10,900	108,782.00	0.03
481	000062	深圳华强	12,212	108,686.80	0.03
482	301015	百洋医药	4,600	108,238.00	0.03
483	000567	海德股份	19,270	108,104.70	0.03
484	000688	国城矿业	11,100	105,672.00	0.03
485	002461	珠江啤酒	14,100	104,622.00	0.03
486	301207	华兰疫苗	5,700	100,719.00	0.03
487	301239	普瑞眼科	2,800	98,924.00	0.03
488	300821	东岳硅材	13,700	93,708.00	0.03
489	001289	龙源电力	5,400	93,150.00	0.03
490	000869	张裕 A	4,300	91,805.00	0.02
491	301498	乖宝宠物	1,600	86,080.00	0.02

492	301268	铭利达	5,400	83,970.00	0.02
493	301165	锐捷网络	2,700	80,568.00	0.02
494	002978	安宁股份	2,800	78,008.00	0.02
495	001308	康冠科技	3,060	68,850.00	0.02
496	002901	大博医疗	2,600	67,158.00	0.02
497	300140	节能环境	11,000	65,670.00	0.02
498	301487	盟固利	2,300	59,478.00	0.02
499	001322	箭牌家居	6,700	48,977.00	0.01
500	301177	迪阿股份	1,600	29,760.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	400174	中天 3	100,100	14,014.00	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	300750	宁德时代	1,657,184.00	0.49
2	300339	润和软件	601,956.00	0.18
3	300760	迈瑞医疗	520,852.00	0.16
4	000766	通化金马	513,892.00	0.15
5	300364	中文在线	436,365.00	0.13
6	301358	湖南裕能	405,645.00	0.12
7	002837	英维克	402,524.20	0.12
8	002240	盛新锂能	369,593.00	0.11
9	000001	平安银行	356,451.00	0.11
10	000543	皖能电力	324,026.00	0.10
11	300498	温氏股份	320,930.00	0.10
12	300475	香农芯创	319,476.00	0.10
13	300735	光弘科技	295,533.00	0.09
14	001965	招商公路	292,108.00	0.09
15	000568	泸州老窖	252,684.00	0.08
16	001979	招商蛇口	248,634.00	0.07
17	300896	爱美客	247,078.00	0.07
18	000425	徐工机械	232,354.00	0.07
19	301301	川宁生物	219,741.00	0.07
20	000651	格力电器	218,916.00	0.07



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	000333	美的集团	291,284.00	0.09
2	002092	ST 中泰	276,769.00	0.08
3	000596	古井贡酒	244,180.00	0.07
4	002706	良信股份	240,106.00	0.07
5	300760	迈瑞医疗	228,959.00	0.07
6	000001	平安银行	228,871.00	0.07
7	002352	顺丰控股	192,233.00	0.06
8	300308	中际旭创	185,012.00	0.06
9	300451	创业慧康	165,070.55	0.05
10	301071	力量钻石	160,028.20	0.05
11	002594	比亚迪	159,343.00	0.05
12	002626	金达威	150,465.00	0.04
13	000858	五粮液	150,150.00	0.04
14	002585	双星新材	146,353.00	0.04
15	300033	同花顺	129,414.00	0.04
16	002612	朗姿股份	120,047.00	0.04
17	000568	泸州老窖	118,914.00	0.04
18	002242	九阳股份	113,266.00	0.03
19	000651	格力电器	111,619.00	0.03
20	300737	科顺股份	111,404.60	0.03

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	26,052,526.40
卖出股票收入（成交）总额	12,287,787.40

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

无。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

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

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,627.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,627.20

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	400174	中天 3	14,014.00	0.00	暂停转让

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
8,224	42,820.34	19,962,498.00	5.67%	179,427,835.00	50.95%	152,764,174.00	43.38%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	广发证券股份有限公司	4,320,924.00	1.23%
2	海通证券股份有限公司	3,208,227.00	0.91%
3	东方证券股份有限公司	3,101,672.00	0.88%
4	山东省国际信托股份有限公司	2,812,800.00	0.80%
5	章斌	2,526,375.00	0.72%
6	广州合心合制冷设备有限公司	1,963,600.00	0.56%
7	刘彦	1,463,900.00	0.42%
8	石海深	1,325,200.00	0.38%
9	王一蕾	1,218,000.00	0.35%
10	缪小燕	1,209,000.00	0.34%
11	中国工商银行股份有限公司-南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	152,764,174.00	43.38%

### 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(2009年12月4日)基金份额总额	4,127,538,537.00
本报告期期初基金份额总额	298,154,507.00
本报告期基金总申购份额	135,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	81,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	352,154,507.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

## 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	
中泰证券	2	19,770,605.04	51.57%	1,977.63	51.57%	-
中信建投	2	7,071,227.00	18.44%	707.06	18.44%	-
华泰证券	4	6,242,808.74	16.28%	624.38	16.28%	-
银河证券	2	3,104,417.22	8.10%	310.60	8.10%	-
国信证券	1	2,151,255.80	5.61%	215.35	5.62%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

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

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

无

减少交易单元：

广发证券

国泰君安

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

				比例		
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	36,290.67	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-05
2	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加申万宏源为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-07
3	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加申万宏源西部为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-07
4	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加联储证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-13
5	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加湘财证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-29
6	关于深证成份交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-18
7	南方基金管理股份有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-20

## § 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	20240101-20240630	138,826,474.00	21,000,000.00	7,062,300.00	152,764,174.00	43.38%

#### 产品特有风险

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

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2024 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>