

南方大数据 300 指数证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告.....	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告.....	56
8.1 期末基金资产组合情况.....	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	57
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	66

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	68
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	68
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	68
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	68
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	68
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	69
8.12 投资组合报告附注.....	69
§9 基金份额持有人信息.....	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	70
9.3 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.....	70
§10 开放式基金份额变动.....	71
§11 重大事件揭示.....	71
11.1 基金份额持有人大会决议.....	71
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
11.4 基金投资策略的改变.....	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	72
11.8 其他重大事件.....	75
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
§13 备查文件目录.....	77
13.1 备查文件目录.....	77
13.2 存放地点.....	77
13.3 查阅方式.....	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方大数据 300 指数证券投资基金	
基金简称	南方大数据 300 指数	
基金主代码	001420	
交易代码	001420	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 24 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	199,012,084.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方大数据 300 指数 A	南方大数据 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	001420	001426
报告期末下属分级基金的份 额总额	169,331,021.40 份	29,681,062.87 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 6%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	大数据 300 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限	中国建设银行股份有限公司

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

1、南方大数据 300 指数 A

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	7,220,575.14	-50,035,305.82	58,671,601.27
本期利润	18,815,066.24	-51,227,211.09	2,076,145.98
加权平均基金份额本期利润	0.1343	-0.3631	0.0131
本期加权平均净值利润率	10.21%	-26.72%	0.83%
本期基金份额净值增长率	11.14%	-22.97%	0.20%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	60,541,890.54	31,001,853.52	83,396,310.40
期末可供分配基金份额利润	0.3575	0.2214	0.5855
期末基金资产净值	229,872,911.94	170,998,429.23	225,817,087.14
期末基金份额净值	1.3575	1.2214	1.5856
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	35.75%	22.14%	58.56%

2、南方大数据 300 指数 C

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	1,225,727.65	-9,484,360.32	9,960,810.15
本期利润	3,475,810.29	-9,922,173.48	204,436.13
加权平均基金份额本期利润	0.1249	-0.3647	0.0070
本期加权平均净值利润率	9.79%	-27.52%	0.46%
本期基金份额净值增长率	10.70%	-23.27%	-0.21%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	9,348,494.11	5,099,262.05	15,700,268.79
期末可供分配基金份额利润	0.3149	0.1878	0.5481
期末基金资产净值	39,029,556.98	32,240,916.51	44,340,963.55
期末基金份额净值	1.3150	1.1879	1.5482
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	31.50%	18.79%	54.82%

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

南方大数据 300 指数 A

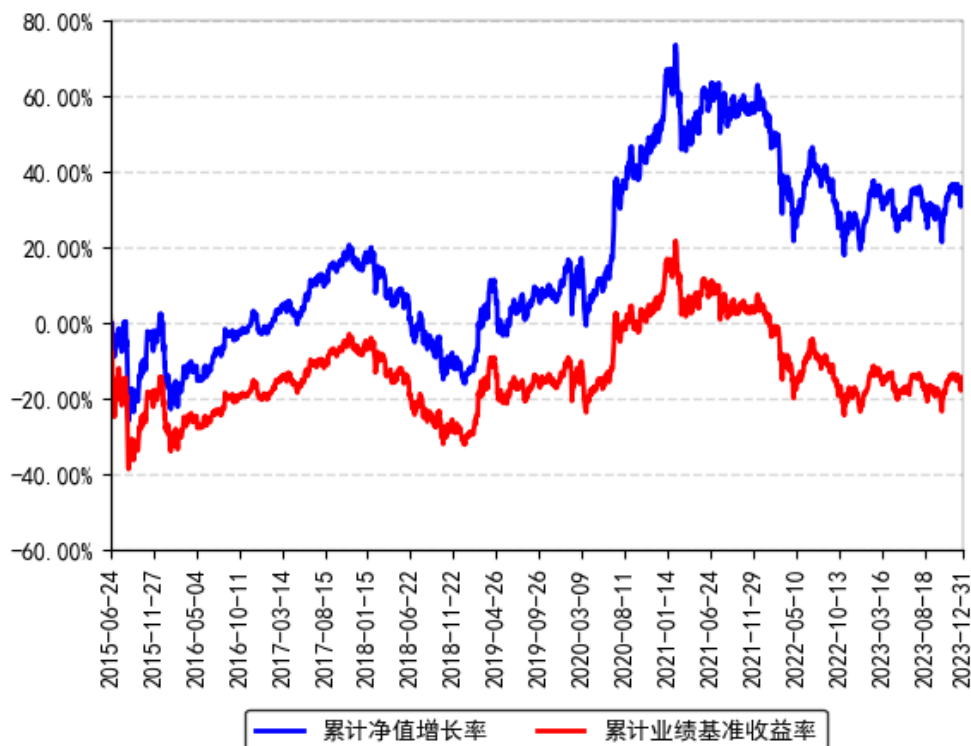
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.01%	0.91%	3.55%	0.96%	0.46%	-0.05%
过去六个月	1.83%	0.90%	0.71%	0.93%	1.12%	-0.03%
过去一年	11.14%	0.87%	9.17%	0.90%	1.97%	-0.03%
过去三年	-14.22%	1.11%	-22.77%	1.13%	8.55%	-0.02%
过去五年	59.97%	1.19%	24.86%	1.19%	35.11%	0.00%
自基金合同生效起至今	35.75%	1.25%	-14.45%	1.32%	50.20%	-0.07%

南方大数据 300 指数 C

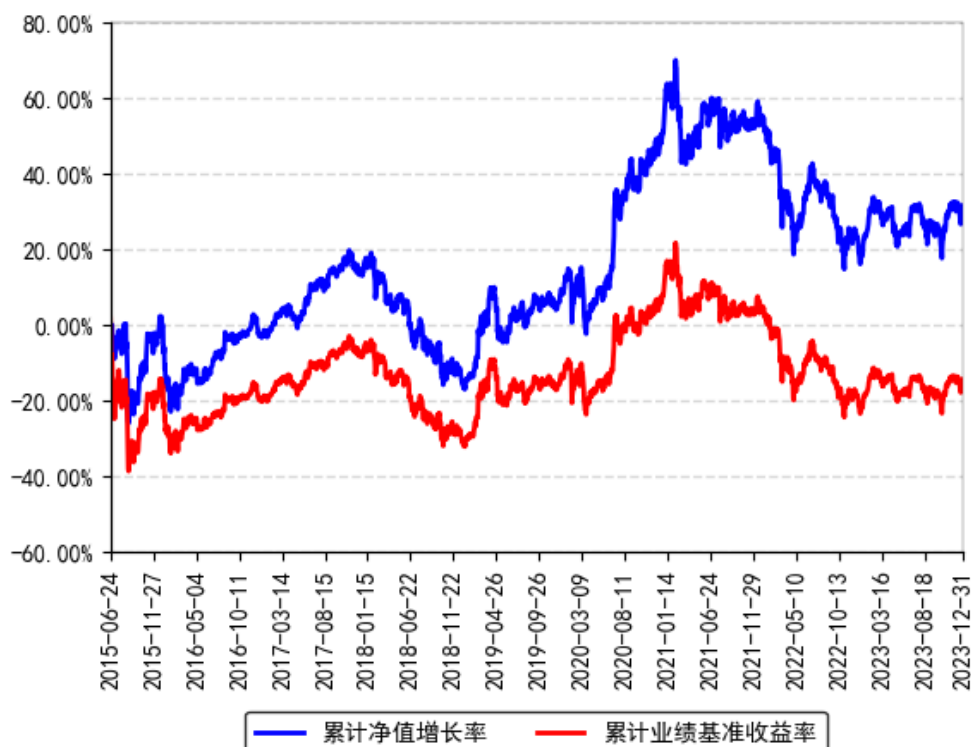
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.90%	0.92%	3.55%	0.96%	0.35%	-0.04%
过去六个月	1.64%	0.90%	0.71%	0.93%	0.93%	-0.03%
过去一年	10.70%	0.87%	9.17%	0.90%	1.53%	-0.03%
过去三年	-15.24%	1.11%	-22.77%	1.13%	7.53%	-0.02%
过去五年	56.81%	1.19%	24.86%	1.19%	31.95%	0.00%
自基金合同生效起至今	31.50%	1.25%	-14.45%	1.32%	45.95%	-0.07%

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

南方大数据300指数A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

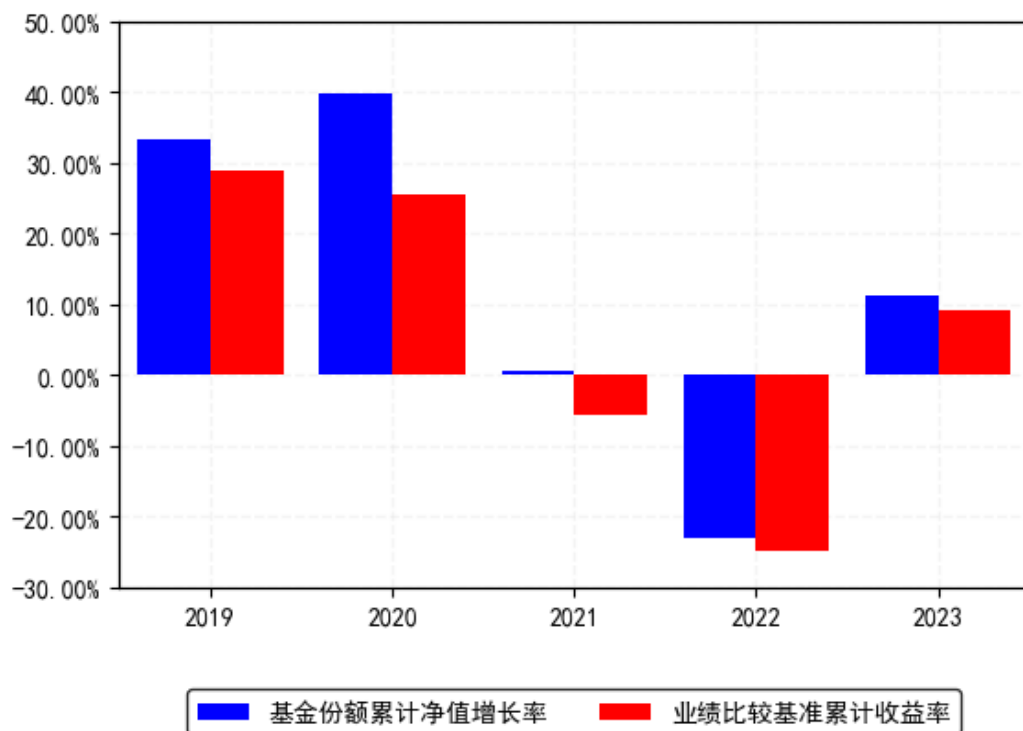


南方大数据300指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

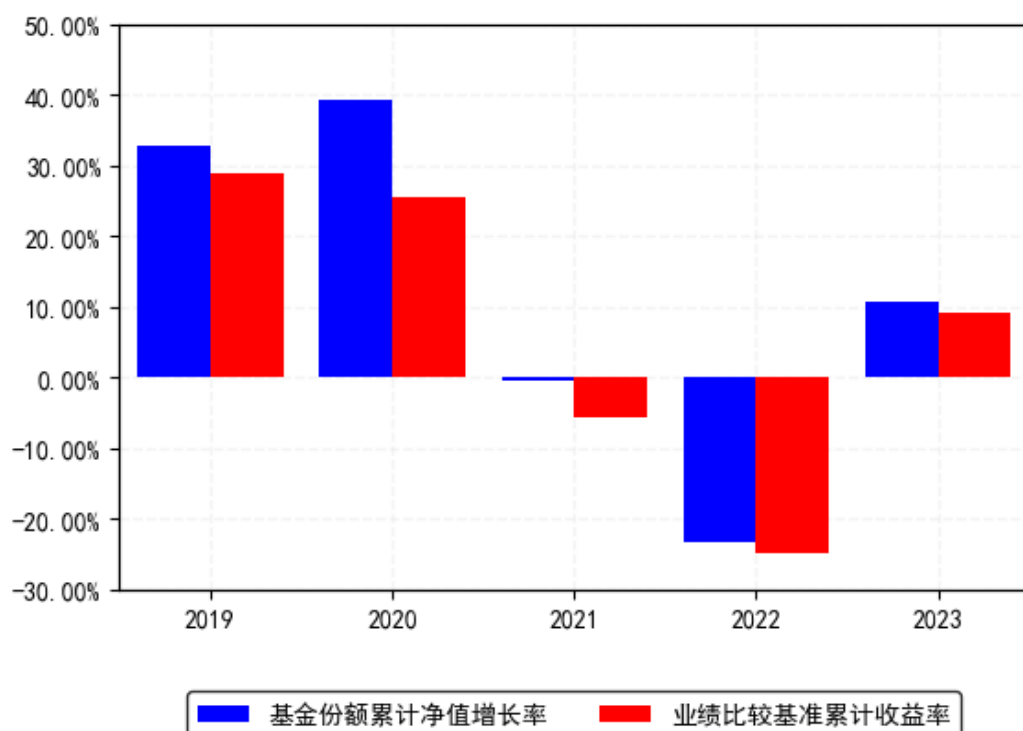


3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方大数据300指数A每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



南方大数据300指数C每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
解锐	本基金基金经理	2022 年 2 月 18 日	-	6 年	清华大学金融专业硕士，具有基金从业资格。2017 年 7 月加入南方基金，任数量化投资部量化研究员；2020 年 8 月 10 日至 2022 年 2 月 18 日，任投资经理；2022 年 2 月 18 日至今，任南方沪深 300 增强、大数据 300 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。

4.1.3 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由工资、奖金等构成。工资由基金经理任职的职位职级决定，重点体现员工能力和职位价值导向原则；奖金由员工的绩效贡献决定，重点体现绩效导向与差异化原则。对于兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理，公司对私募资产管理计划产生的超额业绩报酬实施对应激励，并依据其管理产品的长期业绩与个人综合贡献情况实施分配。为贯彻激励约束相结合、激励与约束并重的管理理念，鼓励长期任职，防范经营风险，公司对

基金经理奖金实施递延发放；同时，为加强员工利益与持有人利益相捆绑及一致性，公司对基金经理实施了跟投购基机制，有效引导基金经理为客户持续创造价值。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 25 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年，本基金投资以跟踪大数据 300 指数为主，期间我们将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.3575 元，报告期内，份额净值增长率为 11.14%，同期业绩基准增长率为 9.17%；本基金 C 份额净值为 1.3150 元，报告期内，份额净值增长率为 10.70%，同期业绩基准增长率为 9.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，伴随着降息降准、减税降费、地产政策等实质性政策的频繁出台，国内经济或企稳回升，信贷需求将逐步企稳，货币政策预计维持宽松。同时，市场整体估值水平和投资者情绪都处于较底部的区域。综合当前时点 A 股的胜率和赔率来看，我们认为 A 股仍具备投资价值。本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度，力求实现对标的指数的有效跟踪。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

在进一步优化制度体系的基础上,本基金管理人贯彻“合规为先,行稳致远”的合规理念,着力创新文化宣传方式,提升宣导效果;优化员工行为检查方式,加强员工行为规范检查力度,严格进行合规问责,强化全员合规、主动合规理念;对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展了定期稽核、专项稽核及多项自查,通过专项稽核和合规检查工作识别问题、防范风险、推动解决,促进公司业务合规运作、稳健经营;根据监管形势和市场形势的变化并结合业务发展的实际情况、各类组合或者业务特点,完善投资合规管理机制,采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作,持续完善投资合规风控制度流程和系统,加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控,有效确保投研交易业务合规运作;全面履行新产品、新业务合规评估程序,保障新产品、新业务合规开展;积极开展合规审核工作,不断强化销售合规风险管控,督促落实投资者适当性管理制度;完成各项信息披露工作,保障所披露信息的真实性、准确性和完整性;开展各类监管组织的投教活动,提升投教质效;监督和落实客户投诉处理,重视媒体监督和投资者关系管理。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内,本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 23021 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方大数据 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了南方大数据 300 指数证券投资基金(以下简称“南方大数据 300 指数基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了南方大数据 300 指数基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于南方大数据 300 指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>南方大数据 300 指数基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估南方大数据 300 指数基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管</p>

	<p>理层计划清算南方大数据 300 指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南方大数据 300 指数基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对南方大数据 300 指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致南方大数据 300 指数基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张振波 吴玲玮
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方大数据 300 指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	36,809,821.15	12,196,067.79
结算备付金		981,438.45	1,948,733.37
存出保证金		8,044.75	11,630.30
交易性金融资产	7.4.7.2	231,839,700.91	190,447,672.76
其中：股票投资		231,839,700.91	190,145,246.24
基金投资		-	-
债券投资		-	302,426.52
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	124,200.39
应收股利		-	-
应收申购款		4,366,349.02	50,105.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		274,005,354.28	204,778,409.94
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,073,017.84	-

应付赎回款		110,261.56	19,827.57
应付管理人报酬		104,423.80	88,081.30
应付托管费		31,327.14	26,424.41
应付销售服务费		13,178.44	11,146.75
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.16	1.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,770,676.42	1,393,583.15
负债合计		5,102,885.36	1,539,064.20
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	199,012,084.27	167,138,230.17
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	69,890,384.65	36,101,115.57
净资产合计		268,902,468.92	203,239,345.74
负债和净资产总计		274,005,354.28	204,778,409.94

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，南方大数据 300 指数 A 份额净值 1.3575 元，基金份额总额 169,331,021.40 份；南方大数据 300 指数 C 份额净值 1.3150 元，基金份额总额 29,681,062.87 份；总份额合计 199,012,084.27 份。

7.2 利润表

会计主体：南方大数据 300 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		24,220,618.82	-59,164,303.85
1.利息收入		71,432.20	80,072.50
其中：存款利息收入	7.4.7.9	71,432.20	78,132.53
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		-	1,939.97
2.投资收益（损失以“-” 填列）		10,227,744.44	-57,642,679.90
其中：股票投资收益	7.4.7.10	8,159,816.75	-61,554,280.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	484,741.89	281,026.01

资产支持证券投资 收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-1,230,940.35
股利收益	7.4.7.15	1,583,185.80	4,861,514.68
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.16	13,844,573.74	-1,629,718.43
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.17	76,868.44	28,021.98
减：二、营业总支出		1,929,742.29	1,985,080.72
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,096,681.89	1,140,947.03
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	329,004.52	342,284.06
3.销售服务费	7.4.10.2.3	141,753.94	144,576.72
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		1.15	7.26
8.其他费用	7.4.7.18	362,300.79	357,265.65
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		22,290,876.53	-61,149,384.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		22,290,876.53	-61,149,384.57
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		22,290,876.53	-61,149,384.57

7.3 净资产变动表

会计主体：南方大数据 300 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	167,138,230.17	-	36,101,115.57	203,239,345.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	167,138,230.17	-	36,101,115.57	203,239,345.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	31,873,854.10	-	33,789,269.08	65,663,123.18
（一）、综合收益总额	-	-	22,290,876.53	22,290,876.53
（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）	31,873,854.10	-	11,498,392.55	43,372,246.65
其中：1.基金申购款	58,797,386.83	-	19,697,111.47	78,494,498.30
2.基金赎回款	-26,923,532.73	-	-8,198,718.92	-35,122,251.65
（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	199,012,084.27	-	69,890,384.65	268,902,468.92
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	171,061,471.50	-	99,096,579.19	270,158,050.69
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	171,061,471.50	-	99,096,579.19	270,158,050.69

资产				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,923,241.33	-	-62,995,463.62	-66,918,704.95
（一）、综合收益总额	-	-	-61,149,384.57	-61,149,384.57
（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）	-3,923,241.33	-	-1,846,079.05	-5,769,320.38
其中：1.基金申购款	18,889,888.74	-	6,462,160.28	25,352,049.02
2.基金赎回款	-22,813,130.07	-	-8,308,239.33	-31,121,369.40
（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	167,138,230.17	-	36,101,115.57	203,239,345.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

____杨小松____ ____常克川____ ____徐超____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方大数据 300 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1051 号《关于准予南方大数据 300 指数证券投资基金注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司,已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,114,455,042.92 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 767 号验资报告予以验证。经向中

国证监会备案,《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,115,000,092.74 份,其中认购资金利息折合 545,049.82 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式或销售机构的不同,将基金份额分为 A 类、C 类基金份额,分别设置基金代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股,可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金 80%以上的基金资产投资于股票(含存托凭证);本基金投资于大数据 300 指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 85%,且不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:大数据 300 指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下

由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率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（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据中国证监会于2024年1月颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》,本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露,这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	36,809,821.15	12,196,067.79
等于：本金	36,805,807.54	12,194,761.99
加：应计利息	4,013.61	1,305.80
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	36,809,821.15	12,196,067.79

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	227,793,336.40	-	231,839,700.91	4,046,364.51	
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	227,793,336.40	-	231,839,700.91	4,046,364.51	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	199,943,455.47	-	190,145,246.24	-9,798,209.23	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	302,400.00	26.52	302,426.52	-
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	302,400.00	26.52	302,426.52	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		200,245,855.47	26.52	190,447,672.76	-9,798,209.23

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	145.52	10.17
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	273,725.39	101,767.47
其中：交易所市场	273,725.39	101,767.47
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应退退补款	-	-
预提费用	90,000.00	85,000.00
应付指数使用费	1,406,805.51	1,206,805.51
可退替代款	-	-
合计	1,770,676.42	1,393,583.15

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方大数据 300 指数 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	139,996,575.71	139,996,575.71
本期申购	45,985,948.33	45,985,948.33
本期赎回（以“-”号填列）	-16,651,502.64	-16,651,502.64
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	169,331,021.40	169,331,021.40

南方大数据 300 指数 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	27,141,654.46	27,141,654.46
本期申购	12,811,438.50	12,811,438.50
本期赎回（以“-”号填列）	-10,272,030.09	-10,272,030.09
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	29,681,062.87	29,681,062.87

注：红利再投及转入份额计入本期申购，转出份额计入本期赎回。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

南方大数据 300 指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	60,997,326.55	-29,995,473.03	31,001,853.52
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	60,997,326.55	-29,995,473.03	31,001,853.52
本期利润	7,220,575.14	11,594,491.10	18,815,066.24
本期基金份额交易产生的变动数	14,267,720.00	-3,542,749.22	10,724,970.78
其中：基金申购款	21,998,967.09	-5,967,597.05	16,031,370.04
基金赎回款	-7,731,247.09	2,424,847.83	-5,306,399.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	82,485,621.69	-21,943,731.15	60,541,890.54

南方大数据 300 指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,801,668.18	-5,702,406.13	5,099,262.05
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	10,801,668.18	-5,702,406.13	5,099,262.05
本期利润	1,225,727.65	2,250,082.64	3,475,810.29
本期基金份额交易产生的变动数	1,115,021.29	-341,599.52	773,421.77
其中：基金申购款	5,491,817.59	-1,826,076.16	3,665,741.43
基金赎回款	-4,376,796.30	1,484,476.64	-2,892,319.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,142,417.12	-3,793,923.01	9,348,494.11

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	62,908.60	44,762.40
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	8,332.21	33,175.31
其他	191.39	194.82
合计	71,432.20	78,132.53

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	621,844,821.43	423,808,088.86
减：卖出股票成本总额	612,434,861.05	484,639,042.90
减：交易费用	1,250,143.63	723,326.20
买卖股票差价收入	8,159,816.75	-61,554,280.24

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	319.20	74,460.08
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	484,422.69	206,565.93
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	484,741.89	281,026.01

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,197,958.98	21,930,643.07
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,713,100.00	21,320,745.10
减：应计利息总额	355.25	403,296.59
减：交易费用	81.04	35.45
买卖债券差价收入	484,422.69	206,565.93

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

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

股指期货-投资收益	-	-1,230,940.35
-----------	---	---------------

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,583,185.80	4,861,514.68
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	1,583,185.80	4,861,514.68

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	13,844,573.74	-1,515,448.43
——股票投资	13,844,573.74	-1,536,216.93
——债券投资	-	20,768.50
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-114,270.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-114,270.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	13,844,573.74	-1,629,718.43

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	64,786.22	23,276.48
基金转换费收入	12,082.22	4,745.50
合计	76,868.44	28,021.98

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	35,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00

证券出借违约金	-	-
指数使用费	200,000.00	200,000.00
银行费用	2,300.79	2,265.65
合计	362,300.79	357,265.65

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	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
南方资本管理有限公司("南方资本")	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司("南方东英")	基金管理人的子公司
厦门国际信托有限公司("厦门国际信托")	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司("深圳投资控股")	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	430,508,619.87	34.35%	432,465,340.11	51.72%
兴业证券	238,640.16	0.02%	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	544,965.23	24.79%	21,408,673.22	99.40%

7.4.10.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	43,106.21	7.11%	231.48	0.08%
兴业证券	23.70	0.00%	23.70	0.01%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	43,248.49	20.32%	19,435.18	19.10%
兴业证券	-	-	-	-

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还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,096,681.89	1,140,947.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	396,060.42	407,674.12
应支付基金管理人的净管理费	700,621.47	733,272.91

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% ÷ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	329,004.52	342,284.06

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方大数据 300 指数 A	南方大数据 300 指数 C	合计
华泰证券	-	1,277.18	1,277.18
南方基金	-	10,991.92	10,991.92
兴业证券	-	27.09	27.09
合计	-	12,296.19	12,296.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方大数据 300 指数 A	南方大数据 300 指数 C	合计
华泰证券	-	1,309.84	1,309.84
南方基金	-	11,314.53	11,314.53
兴业证券	-	28.18	28.18
合计	-	12,652.55	12,652.55

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% \div \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	36,809,821.15	62,908.60	12,196,067.79	44,762.40

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	688472	阿特斯	网下申购	8,903	98,823.30
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	2,488	80,909.76
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	3,496	73,136.32
华泰联合	301421	波长光电	网下申购	2,323	68,249.74
华泰联合	301519	舜禹股份	网下申购	3,245	67,917.85
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	301413	安培龙	网下申购	1,633	54,297.25
华泰联合	301566	达利凯普	网下申购	5,755	51,219.50
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	2,535	48,672.00
华泰联合	301487	盟固利	网下申购	8,662	46,081.84
华泰联合	688720	艾森股份	网下申购	1,644	46,081.32
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券	127083	山路转债	配债	3,770	377,000.00
兴业证券	301322	绿通科技	网下申购	673	88,237.03
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	1,944	62,771.76

兴业证券	301578	辰奕智能	网下申购	1,175	57,504.50
兴业证券	113670	金 23 转债	配债	510	51,000.00
兴业证券,华泰联合	688469	芯联集成	网下申购	25,115	142,904.35

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	6,745	151,964.85
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	1,594	128,795.20
华泰联合	301195	北路智控	网下申购	1,550	110,313.50
华泰联合	110085	通 22 转债	配债	1,070	107,000.00
华泰联合	113062	常银转债	配债	930	93,000.00
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	1,630	92,714.40
华泰联合	113055	成银转债	配债	670	67,000.00
华泰联合	301316	慧博云通	网下申购	3,584	27,238.40
华泰联合	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
兴业证券	600030	中信证券	配股	20,850	300,865.50
兴业证券	301165	锐捷网络	网下申购	2,541	82,277.58
兴业证券	603280	南方路机	网下申购	363	8,621.25

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301487	盟固利	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股锁定期	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301526	国际复材	2023 年 12 月 19 日	6 个月	新股锁定期	2.66	4.45	3,454	9,187.64	15,370.30	-
301510	固高科技	2023	6 个月	新股锁	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-

		年 8 月 4 日		定期						
301421	波长光电	2023 年 8 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	29.38	59.37	233	6,845.54	13,833.21	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股锁 定期	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	39.78	69.09	180	7,160.40	12,436.20	-
688627	精智达	2023 年 7 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	46.77	87.72	139	6,501.03	12,193.08	-
301370	国科恒泰	2023 年 7 月 3 日	6 个月	新股锁 定期	13.39	16.01	689	9,225.71	11,030.89	-
301558	三态股份	2023 年 9 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	7.33	13.40	823	6,032.59	11,028.20	-
688548	广钢气体	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	9.87	12.75	819	8,083.53	10,442.25	-
688563	航材股份	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	78.99	60.49	164	12,954.36	9,920.36	-
301499	维科精密	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	19.50	28.93	334	6,513.00	9,662.62	-
688549	中巨芯	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	5.18	8.09	1,190	6,164.20	9,627.10	-
301413	安培龙	2023 年 12 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301372	科净源	2023 年 8 月 3 日	6 个月	新股锁 定期	45.00	43.59	217	9,765.00	9,459.03	-
301516	中远通	2023 年 12 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
688592	司南导航	2023 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁 定期	50.50	50.53	184	9,292.00	9,297.52	-

301509	金凯生科	2023 年 7 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	56.56	62.23	141	7,974.96	8,774.43	-
688652	京仪装备	2023 年 11 月 22 日	6 个月	新股锁 定期	31.95	52.25	167	5,335.65	8,725.75	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	26.74	38.67	225	6,016.50	8,700.75	-
301362	民爆光电	2023 年 7 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	51.05	38.52	215	10,975.75	8,281.80	-
688591	泰凌微	2023 年 8 月 18 日	6 个月	新股锁 定期	24.98	28.02	295	7,369.10	8,265.90	-
688720	艾森股份	2023 年 11 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	6 个月	新股锁 定期	16.82	26.68	307	5,163.74	8,190.76	-
301507	民生健康	2023 年 8 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	10.00	15.85	514	5,140.00	8,146.90	-
301578	辰奕智能	2023 年 12 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	55.00	74.14	108	5,940.00	8,007.12	-
688653	康希通信	2023 年 11 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	10.50	15.99	492	5,166.00	7,867.08	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	36.90	50.85	147	5,424.30	7,474.95	-
301533	威马农机	2023 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁 定期	29.50	33.16	222	6,549.00	7,361.52	-
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
688651	盛邦安全	2023 年 7 月	6 个月	新股锁 定期	39.90	46.05	156	6,224.40	7,183.80	-

		19 日								
688702	盛科通信	2023 年 9 月 6 日	6 个月	新股锁定期	42.66	48.18	148	6,313.68	7,130.64	-
301511	德福科技	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新股锁定期	28.00	22.67	314	8,792.00	7,118.38	-
301489	思泉新材	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁定期	41.66	64.11	110	4,582.60	7,052.10	-
301505	苏州规划	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股锁定期	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
601096	宏盛华源	2023 年 12 月 15 日	6 个月	新股锁定期	1.70	4.06	1,698	2,886.60	6,893.88	-
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	6 个月	新股锁定期	23.23	35.58	191	4,436.93	6,795.78	-
301251	威尔高	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股锁定期	28.88	34.59	193	5,573.84	6,675.87	-
301459	丰茂股份	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股锁定期	31.90	39.84	167	5,327.30	6,653.28	-
301517	陕西华达	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定期	26.87	43.69	152	4,084.24	6,640.88	-
301519	舜禹股份	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股锁定期	20.93	20.21	325	6,802.25	6,568.25	-
688648	中邮科技	2023 年 11 月 6 日	6 个月	新股锁定期	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
301418	协昌科技	2023 年 8 月 10 日	6 个月	新股锁定期	51.88	50.20	129	6,692.52	6,475.80	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定期	57.66	47.25	136	7,841.76	6,426.00	-
301393	昊帆生物	2023 年 7 月 5 日	6 个月	新股锁定期	67.68	59.37	108	7,309.44	6,411.96	-
301528	多浦乐	2023	6 个月	新股锁	71.80	68.91	92	6,605.60	6,339.72	-

		年 8 月 17 日		定期						
301550	斯菱股份	2023 年 9 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	37.56	43.57	142	5,333.52	6,186.94	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	25.82	31.80	192	4,957.44	6,105.60	-
688716	中研股份	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	29.66	36.39	158	4,686.28	5,749.62	-
301456	盘古智能	2023 年 7 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	37.96	30.39	189	7,174.44	5,743.71	-
301515	港通医疗	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	31.16	28.27	188	5,858.08	5,314.76	-
688719	爱科赛博	2023 年 9 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	69.98	60.10	88	6,158.24	5,288.80	-
301500	飞南资源	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	23.97	20.89	237	5,680.89	4,950.93	-
301559	中集环科	2023 年 9 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	24.22	18.24	267	6,466.74	4,870.08	-
688646	逸飞激光	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	46.80	36.07	135	6,318.00	4,869.45	-
301529	福赛科技	2023 年 8 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	36.60	37.88	126	4,611.60	4,772.88	-
301520	万邦医药	2023 年 9 月 18 日	6 个月	新股锁 定期	67.88	52.74	90	6,109.20	4,746.60	-
301525	儒竞科技	2023 年 8 月 23 日	6 个月	新股锁 定期	99.57	81.46	58	5,775.06	4,724.68	-
301548	崇德科技	2023 年 9 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	66.80	58.99	75	5,010.00	4,424.25	-
301371	敷尔佳	2023 年 7 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	55.68	37.58	117	6,514.56	4,396.86	-

688612	威迈斯	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	47.29	37.97	113	5,343.77	4,290.61	-
601083	锦江航运	2023 年 11 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	11.25	11.07	367	4,128.75	4,062.69	-
603004	鼎龙科技	2023 年 12 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	16.80	31.19	126	2,116.80	3,929.94	-
688450	光格科技	2023 年 7 月 17 日	6 个月	新股锁 定期	53.09	36.42	106	5,627.54	3,860.52	-
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
603270	金帝股份	2023 年 8 月 25 日	6 个月	新股锁 定期	21.77	29.58	120	2,612.40	3,549.60	-
603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	53.63	75.36	42	2,252.46	3,165.12	-
603373	安邦护卫	2023 年 12 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	41.00	44.16	67	2,747.00	2,958.72	-
603275	众辰科技	2023 年 8 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	49.97	39.70	72	3,597.84	2,858.40	-
603119	浙江荣泰	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	15.32	23.87	116	1,777.12	2,768.92	-
603107	上海汽配	2023 年 10 月 25 日	6 个月	新股锁 定期	14.23	18.19	148	2,106.04	2,692.12	-
603193	润本股份	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	17.38	16.66	147	2,554.86	2,449.02	-
603276	恒兴新材	2023 年 9 月	6 个月	新股锁 定期	25.73	24.88	97	2,495.81	2,413.36	-

		18 日								
603231	索宝蛋白	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股锁定期	21.29	21.53	106	2,256.74	2,282.18	-
603075	热威股份	2023 年 9 月 1 日	6 个月	新股锁定期	23.10	23.31	87	2,009.70	2,027.97	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

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

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

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

4. 基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数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。本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，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。但在因特殊情况下，本基金将配合使用优化方法作为补充，以保证对标的指数的有效跟踪。

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之内。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本期末,本基金无债券投资(上期末:本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金净资产的比例为 0.15%)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

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

于本期末,本基金的卖出回购金融资产款(若有)计息且利息金额不重大;除此之外,本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息,该部分账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

净值的 15%。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合该要求。

本基金的基金管理人对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	36,809,821.15	-	-	-	36,809,821.15
结算备付金	981,438.45	-	-	-	981,438.45
存出保证金	8,044.75	-	-	-	8,044.75
交易性金融资产	-	-	-	231,839,700.91	231,839,700.91

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	-	-	-	4,366,349.02	4,366,349.02
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	37,799,304.35	-	-	236,206,049.93	274,005,354.28
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	3,073,017.84	3,073,017.84
应付赎回款	-	-	-	110,261.56	110,261.56
应付管理人报酬	-	-	-	104,423.80	104,423.80
应付托管费	-	-	-	31,327.14	31,327.14
应付销售服务费	-	-	-	13,178.44	13,178.44
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.16	0.16
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,770,676.42	1,770,676.42
负债总计	-	-	-	5,102,885.36	5,102,885.36
利率敏感度缺口	37,799,304.35	-	-	231,103,164.57	268,902,468.92
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2022年12月31日					
资产					
货币资金	12,196,067.79	-	-	-	12,196,067.79
结算备付金	1,948,733.37	-	-	-	1,948,733.37
存出保证金	11,630.30	-	-	-	11,630.30
交易性金融资产	-	-	302,426.52	190,145,246.24	190,447,672.76
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	-	-	-	124,200.39	124,200.39
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	50,105.33	50,105.33
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,156,431.46	-	302,426.52	190,319,551.96	204,778,409.94
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	-	-	-	19,827.57	19,827.57
应付管理人报酬	-	-	-	88,081.30	88,081.30
应付托管费	-	-	-	26,424.41	26,424.41
应付销售服务费	-	-	-	11,146.75	11,146.75
应付投资顾问费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	1.02	1.02
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税 负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,393,583.15	1,393,583.15
负债总计	-	-	-	1,539,064.20	1,539,064.20
利率敏感度 缺口	14,156,431.4 6	-	302,426.52	188,780,487. 76	203,239,345. 74

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	0.00	-4,309.31
2.市场利率平行下降25个基点	0.00	4,382.83	

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，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80%以上的基金资产投资于股票（含存托凭证）；本基金投资于大数据300指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的85%，且不低于非现金基金资产的80%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	231,839,700.91	86.22	190,145,246.24	93.56
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	231,839,700.91	86.22	190,145,246.24	93.56

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	12,923,211.93	9,924,405.83
	2.组合自身基准下降 5%	-12,923,211.93	-9,924,405.83

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	231,277,550.51	187,857,550.12
第二层次	-	302,426.52
第三层次	562,150.40	2,287,696.12
合计	231,839,700.91	190,447,672.76

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票	
期初余额	-	2,287,696.12	2,287,696.12
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	848,377.64	848,377.64
转出第三层次	-	2,784,593.77	2,784,593.77
当期利得或损失总额	-	210,670.41	210,670.41
其中：计入损益的利得或损失	-	210,670.41	210,670.41
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	562,150.40	562,150.40
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	132,637.36	132,637.36
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票	
期初余额	-	495,109.08	495,109.08
当期购买	-	1,999,930.44	1,999,930.44
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,952,897.46	1,952,897.46
转出第三层次	-	2,239,287.68	2,239,287.68
当期利得或损失总额	-	79,046.82	79,046.82
其中：计入损益的利得或损失	-	79,046.82	79,046.82

计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,287,696.12	2,287,696.12
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-397,840.83	-397,840.83

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

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	562,150.40	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962~2.1988	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	2,287,696.12	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2319~2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上期末：同）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	231,839,700.91	84.61
	其中：股票	231,839,700.91	84.61
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	37,791,259.60	13.79
8	其他资产	4,374,393.77	1.60
9	合计	274,005,354.28	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	1,713,989.00	0.64
B	采矿业	-	-
C	制造业	147,068,180.02	54.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,292,277.00	6.43
E	建筑业	2,546,095.00	0.95
F	批发和零售业	8,087,102.09	3.01
G	交通运输、仓储和邮政业	4,903,340.69	1.82
H	住宿和餐饮业	2,119,830.00	0.79
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,562,690.73	3.93
J	金融业	922,800.00	0.34
K	房地产业	3,024,340.00	1.12
L	租赁和商务服务业	4,357,107.00	1.62
M	科学研究和技术服务业	2,212,058.50	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	19,041,159.88	7.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,729,735.00	0.64
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,780,632.00	1.78
S	综合	1,478,364.00	0.55

合计	231,839,700.91	86.22
----	----------------	-------

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000089	深圳机场	492,000	3,163,560.00	1.18
2	688127	蓝特光学	88,867	2,069,712.43	0.77
3	002891	中宠股份	73,800	1,944,630.00	0.72
4	603699	纽威股份	134,400	1,862,784.00	0.69
5	002327	富安娜	201,200	1,800,740.00	0.67
6	605377	华旺科技	91,800	1,752,462.00	0.65
7	603590	康辰药业	45,600	1,736,448.00	0.65
8	002392	北京利尔	448,300	1,694,574.00	0.63
9	600979	广安爱众	465,800	1,611,668.00	0.60
10	000888	峨眉山 A	174,700	1,560,071.00	0.58
11	605289	罗曼股份	26,400	1,518,000.00	0.56
12	000601	韶能股份	352,000	1,506,560.00	0.56
13	002677	浙江美大	147,200	1,488,192.00	0.55
14	000551	创元科技	141,200	1,478,364.00	0.55
15	000791	甘肃能源	265,000	1,476,050.00	0.55
16	002479	富春环保	288,000	1,373,760.00	0.51
17	002870	香山股份	37,900	1,359,473.00	0.51
18	002991	甘源食品	18,700	1,336,302.00	0.50
19	002630	华西能源	526,800	1,306,464.00	0.49
20	688246	嘉和美康	38,968	1,302,310.56	0.48
21	600054	黄山旅游	119,200	1,296,896.00	0.48
22	002083	孚日股份	257,200	1,296,288.00	0.48
23	000531	穗恒运 A	191,800	1,283,142.00	0.48
24	003038	鑫铂股份	36,800	1,264,080.00	0.47
25	000920	沃顿科技	126,800	1,259,124.00	0.47
26	688626	翔宇医疗	23,376	1,245,707.04	0.46
27	600292	远达环保	204,300	1,240,101.00	0.46
28	002990	盛视科技	35,500	1,225,815.00	0.46
29	002641	公元股份	242,400	1,219,272.00	0.45
30	688368	晶丰明源	11,267	1,216,159.98	0.45
31	603277	银都股份	44,800	1,201,536.00	0.45
32	002880	卫光生物	33,800	1,187,394.00	0.44

33	000797	中国武夷	389,900	1,165,801.00	0.43
34	600628	新世界	165,500	1,160,155.00	0.43
35	300860	锋尚文化	21,200	1,158,156.00	0.43
36	600684	珠江股份	326,600	1,133,302.00	0.42
37	688336	三生国健	50,331	1,132,950.81	0.42
38	601368	绿城水务	210,400	1,125,640.00	0.42
39	688510	航亚科技	63,449	1,117,971.38	0.42
40	603208	江山欧派	37,400	1,110,406.00	0.41
41	002860	星帅尔	85,200	1,103,340.00	0.41
42	301127	天源环保	100,300	1,102,297.00	0.41
43	002186	全聚德	94,500	1,101,870.00	0.41
44	002103	广博股份	137,100	1,098,171.00	0.41
45	600506	统一股份	60,200	1,095,038.00	0.41
46	603366	日出东方	172,900	1,077,167.00	0.40
47	002918	蒙娜丽莎	79,200	1,072,368.00	0.40
48	600379	宝光股份	106,600	1,071,330.00	0.40
49	000850	华茂股份	279,100	1,063,371.00	0.40
50	601996	丰林集团	371,200	1,057,920.00	0.39
51	300791	仙乐健康	30,500	1,057,130.00	0.39
52	601199	江南水务	211,800	1,050,528.00	0.39
53	002749	国光股份	86,400	1,035,072.00	0.38
54	002731	萃华珠宝	93,100	1,029,686.00	0.38
55	600854	春兰股份	195,100	1,028,177.00	0.38
56	603950	长源东谷	66,440	1,023,176.00	0.38
57	300719	安达维尔	76,400	1,018,412.00	0.38
58	000428	华天酒店	249,500	1,017,960.00	0.38
59	000421	南京公用	144,300	1,008,657.00	0.38
60	000978	桂林旅游	133,400	1,008,504.00	0.38
61	002381	双箭股份	132,900	1,007,382.00	0.37
62	002752	昇兴股份	193,800	1,003,884.00	0.37
63	688292	浩瀚深度	36,419	1,002,250.88	0.37
64	600358	国旅联合	189,200	991,408.00	0.37
65	000695	滨海能源	91,300	986,953.00	0.37
66	688398	赛特新材	31,108	983,012.80	0.37
67	603333	尚纬股份	171,600	979,836.00	0.36
68	002970	锐明技术	31,800	973,398.00	0.36
69	300969	恒帅股份	10,800	970,596.00	0.36
70	002394	联发股份	115,800	962,298.00	0.36
71	002264	新华都	173,700	957,087.00	0.36
72	688168	安博通	26,417	955,238.72	0.36
73	603897	长城科技	46,300	948,224.00	0.35
74	603758	秦安股份	82,400	942,656.00	0.35
75	600661	昂立教育	87,800	939,460.00	0.35

76	002543	万和电气	105,300	939,276.00	0.35
77	002946	新乳业	81,800	939,064.00	0.35
78	000619	海螺新材	135,000	934,200.00	0.35
79	603121	华培动力	85,490	929,276.30	0.35
80	000430	张家界	142,700	928,977.00	0.35
81	300829	金丹科技	44,400	927,072.00	0.34
82	600448	华纺股份	280,500	925,650.00	0.34
83	300422	博世科	154,400	924,856.00	0.34
84	603093	南华期货	76,900	922,800.00	0.34
85	600250	南京商旅	77,300	912,913.00	0.34
86	603530	神马电力	43,900	910,486.00	0.34
87	603315	福鞍股份	62,600	909,578.00	0.34
88	000524	岭南控股	102,000	908,820.00	0.34
89	603817	海峡环保	142,100	906,598.00	0.34
90	000037	深南电 A	110,100	905,022.00	0.34
91	300815	玉禾田	61,900	903,740.00	0.34
92	300893	松原股份	30,900	903,207.00	0.34
93	603999	读者传媒	131,200	901,344.00	0.34
94	600834	申通地铁	108,700	894,601.00	0.33
95	600231	凌钢股份	415,700	893,755.00	0.33
96	603739	蔚蓝生物	58,500	890,370.00	0.33
97	002878	元隆雅图	47,700	887,697.00	0.33
98	603099	长白山	58,800	880,824.00	0.33
99	000678	襄阳轴承	135,100	874,097.00	0.33
100	688580	伟思医疗	13,402	856,789.86	0.32
101	301061	匠心家居	17,200	855,700.00	0.32
102	301109	军信股份	54,000	853,200.00	0.32
103	300577	开润股份	58,100	852,327.00	0.32
104	300715	凯伦股份	72,700	847,682.00	0.32
105	300908	仲景食品	20,500	846,035.00	0.31
106	002730	电光科技	88,800	841,824.00	0.31
107	603365	水星家纺	58,200	836,916.00	0.31
108	002820	桂发祥	72,300	825,666.00	0.31
109	300625	三雄极光	55,564	823,458.48	0.31
110	603536	惠发食品	53,000	823,090.00	0.31
111	600735	新华锦	126,700	817,215.00	0.30
112	603116	红蜻蜓	130,100	814,426.00	0.30
113	002187	广百股份	129,000	813,990.00	0.30
114	605286	同力日升	26,900	803,234.00	0.30
115	300265	通光线缆	86,700	802,842.00	0.30
116	301011	华立科技	34,300	802,620.00	0.30
117	300501	海顺新材	55,600	802,308.00	0.30
118	605167	利柏特	84,500	801,905.00	0.30

119	603303	得邦照明	62,400	801,840.00	0.30
120	002574	明牌珠宝	132,300	793,800.00	0.30
121	301257	普蕊斯	12,500	793,750.00	0.30
122	605098	行动教育	20,500	790,275.00	0.29
123	002722	物产金轮	50,300	775,123.00	0.29
124	600749	西藏旅游	65,800	773,808.00	0.29
125	002616	长青集团	147,300	773,325.00	0.29
126	002159	三特索道	50,600	772,156.00	0.29
127	600847	万里股份	64,700	771,224.00	0.29
128	603797	联泰环保	139,600	770,592.00	0.29
129	002494	华斯股份	138,900	766,728.00	0.29
130	600235	民丰特纸	124,700	765,658.00	0.28
131	002290	禾盛新材	58,400	759,784.00	0.28
132	002846	英联股份	69,200	757,740.00	0.28
133	300805	电声股份	67,400	754,880.00	0.28
134	603230	内蒙新华	48,700	754,850.00	0.28
135	688136	科兴制药	37,274	754,798.50	0.28
136	603080	新疆火炬	45,300	754,698.00	0.28
137	600644	乐山电力	108,400	754,464.00	0.28
138	603112	华翔股份	62,000	753,300.00	0.28
139	600505	西昌电力	88,400	750,516.00	0.28
140	688386	泛亚微透	18,354	748,843.20	0.28
141	300882	万胜智能	30,700	747,852.00	0.28
142	603725	天安新材	66,500	740,145.00	0.28
143	600287	江苏舜天	116,900	737,639.00	0.27
144	002969	嘉美包装	176,400	726,768.00	0.27
145	002016	世荣兆业	115,300	725,237.00	0.27
146	601999	出版传媒	97,300	723,912.00	0.27
147	688101	三达膜	53,457	719,531.22	0.27
148	600241	时代万恒	80,200	719,394.00	0.27
149	002798	帝欧家居	109,800	719,190.00	0.27
150	688058	宝兰德	15,224	718,725.04	0.27
151	002899	英派斯	43,300	716,615.00	0.27
152	603038	华立股份	61,600	711,480.00	0.26
153	600573	惠泉啤酒	68,500	711,030.00	0.26
154	002209	达意隆	64,600	710,600.00	0.26
155	600333	长春燃气	139,400	705,364.00	0.26
156	300947	德必集团	44,900	704,481.00	0.26
157	301070	开勒股份	15,700	704,302.00	0.26
158	301196	唯科科技	20,400	701,352.00	0.26
159	603103	横店影视	39,300	698,754.00	0.26
160	605339	南侨食品	37,100	698,593.00	0.26
161	603577	汇金通	67,100	697,840.00	0.26

162	600778	友好集团	111,500	696,875.00	0.26
163	003028	振邦智能	15,700	691,742.00	0.26
164	600099	林海股份	67,000	684,740.00	0.25
165	600819	耀皮玻璃	134,300	683,587.00	0.25
166	002732	燕塘乳业	35,600	683,520.00	0.25
167	300670	大烨智能	87,000	681,210.00	0.25
168	300464	星徽股份	112,200	675,444.00	0.25
169	603689	皖天然气	77,200	670,868.00	0.25
170	301033	迈普医学	15,400	670,516.00	0.25
171	600493	凤竹纺织	99,600	669,312.00	0.25
172	001323	慕思股份	21,800	664,900.00	0.25
173	603551	奥普家居	62,700	663,993.00	0.25
174	300898	熊猫乳品	27,100	654,736.00	0.24
175	603286	日盈电子	25,200	651,924.00	0.24
176	600796	钱江生化	110,600	647,010.00	0.24
177	688310	迈得医疗	21,540	644,046.00	0.24
178	002973	侨银股份	58,600	642,842.00	0.24
179	603822	嘉澳环保	23,100	642,411.00	0.24
180	603903	中持股份	64,300	635,284.00	0.24
181	603214	爱婴室	38,800	634,768.00	0.24
182	600156	华升股份	128,400	631,728.00	0.23
183	600593	大连圣亚	32,100	631,086.00	0.23
184	600689	上海三毛	54,400	629,408.00	0.23
185	002715	登云股份	38,700	628,101.00	0.23
186	600865	百大集团	76,300	622,608.00	0.23
187	600097	开创国际	57,900	618,951.00	0.23
188	688226	威腾电气	32,613	613,124.40	0.23
189	688393	安必平	24,225	604,898.25	0.22
190	300695	兆丰股份	11,400	603,744.00	0.22
191	001207	联科科技	35,400	603,570.00	0.22
192	002949	华阳国际	42,700	596,519.00	0.22
193	300824	北鼎股份	64,900	586,047.00	0.22
194	300069	金利华电	35,800	576,380.00	0.21
195	605158	华达新材	75,700	575,320.00	0.21
196	003003	天元股份	50,000	574,500.00	0.21
197	002980	华盛昌	20,900	572,660.00	0.21
198	601798	蓝科高新	74,100	563,901.00	0.21
199	603500	祥和实业	45,900	562,275.00	0.21
200	300621	维业股份	48,500	557,265.00	0.21
201	603321	梅轮电梯	64,700	552,538.00	0.21
202	603029	天鹅股份	26,900	548,760.00	0.20
203	002763	汇洁股份	64,800	544,968.00	0.20
204	002905	金逸影视	49,600	543,616.00	0.20

205	300626	华瑞股份	50,000	542,500.00	0.20
206	300877	金春股份	31,000	536,610.00	0.20
207	002333	罗普斯金	82,000	535,460.00	0.20
208	603839	安正时尚	63,700	528,710.00	0.20
209	603238	诺邦股份	38,400	528,000.00	0.20
210	603097	江苏华辰	22,000	527,780.00	0.20
211	301187	欧圣电气	26,100	519,651.00	0.19
212	605122	四方新材	32,100	517,773.00	0.19
213	605179	一鸣食品	34,800	515,040.00	0.19
214	605162	新中港	55,900	513,721.00	0.19
215	688314	康拓医疗	15,404	506,945.64	0.19
216	605050	福然德	41,000	505,530.00	0.19
217	301229	纽泰格	15,200	505,400.00	0.19
218	688288	鸿泉物联	21,253	504,971.28	0.19
219	301066	万事利	39,100	503,608.00	0.19
220	301318	维海德	14,200	502,822.00	0.19
221	688793	倍轻松	14,854	499,837.10	0.19
222	688681	科汇股份	32,320	499,344.00	0.19
223	603680	今创集团	52,700	498,015.00	0.19
224	605300	佳禾食品	31,800	497,988.00	0.19
225	605005	合兴股份	28,300	496,382.00	0.18
226	603057	紫燕食品	22,968	495,649.44	0.18
227	300816	艾可蓝	20,000	493,400.00	0.18
228	300823	建科机械	22,800	490,428.00	0.18
229	001229	魅视科技	13,600	484,160.00	0.18
230	688051	佳华科技	14,455	482,074.25	0.18
231	301223	中荣股份	26,400	478,368.00	0.18
232	301077	星华新材	23,500	477,755.00	0.18
233	300899	上海凯鑫	17,500	475,650.00	0.18
234	600828	茂业商业	129,900	474,135.00	0.18
235	603992	松霖科技	26,100	473,454.00	0.18
236	002811	郑中设计	47,800	470,830.00	0.18
237	605500	森林包装	59,311	470,336.23	0.17
238	603159	上海亚虹	28,400	465,760.00	0.17
239	300864	南大环境	21,200	464,492.00	0.17
240	300849	锦盛新材	34,900	462,076.00	0.17
241	605288	凯迪股份	9,800	461,776.00	0.17
242	603511	爱慕股份	29,758	460,653.84	0.17
243	301055	张小泉	31,900	459,998.00	0.17
244	300851	交大思诺	14,600	455,082.00	0.17
245	605580	恒盛能源	38,900	452,018.00	0.17
246	688718	唯赛勃	29,900	446,706.00	0.17
247	001216	华瓷股份	34,100	445,005.00	0.17

248	300907	康平科技	20,000	443,800.00	0.17
249	605169	洪通燃气	39,100	443,003.00	0.16
250	688109	品茗科技	15,608	439,677.36	0.16
251	003018	金富科技	41,000	436,650.00	0.16
252	300998	宁波方正	18,900	436,212.00	0.16
253	688571	杭华股份	57,503	430,122.44	0.16
254	688067	爱威科技	18,014	428,913.34	0.16
255	301148	嘉戎技术	19,400	427,770.00	0.16
256	003030	祖名股份	19,700	425,520.00	0.16
257	002633	申科股份	36,200	423,178.00	0.16
258	688193	仁度生物	9,311	420,112.32	0.16
259	688616	西力科技	30,569	416,961.16	0.16
260	603685	晨丰科技	27,000	412,830.00	0.15
261	688171	纬德信息	18,209	409,702.50	0.15
262	301008	宏昌科技	13,500	407,565.00	0.15
263	603326	我乐家居	43,100	406,433.00	0.15
264	000020	深华发 A	31,200	404,040.00	0.15
265	002836	新宏泽	45,600	399,000.00	0.15
266	605268	王力安防	40,900	398,366.00	0.15
267	300854	中兰环保	22,600	394,370.00	0.15
268	605155	西大门	25,360	392,572.80	0.15
269	001211	双枪科技	16,200	391,392.00	0.15
270	001209	洪兴股份	21,800	390,438.00	0.15
271	001234	泰慕士	15,900	388,914.00	0.14
272	001222	源飞宠物	26,300	386,610.00	0.14
273	605055	迎丰股份	53,700	383,955.00	0.14
274	603848	好太太	24,800	383,904.00	0.14
275	603048	浙江黎明	20,500	380,685.00	0.14
276	001316	润贝航科	10,900	379,429.00	0.14
277	603320	迪贝电气	23,700	377,067.00	0.14
278	300819	聚杰微纤	24,200	376,310.00	0.14
279	603787	新日股份	30,000	375,300.00	0.14
280	301056	森赫股份	36,400	372,008.00	0.14
281	301001	凯淳股份	14,500	370,330.00	0.14
282	688178	万德斯	20,120	363,769.60	0.14
283	001230	劲旅环境	15,300	358,938.00	0.13
284	603829	洛凯股份	21,800	355,994.00	0.13
285	688379	华光新材	17,863	353,151.51	0.13
286	688611	杭州柯林	10,674	349,893.72	0.13
287	688466	金科环境	19,616	348,184.00	0.13
288	003041	真爱美家	20,400	339,660.00	0.13
289	300984	金沃股份	12,100	338,316.00	0.13
290	001202	炬申股份	19,100	335,587.00	0.12

291	301227	森鹰窗业	12,300	332,961.00	0.12
292	603221	爱丽家居	33,100	329,014.00	0.12
293	301113	雅艺科技	10,100	325,927.00	0.12
294	301043	绿岛风	9,900	324,027.00	0.12
295	301359	东南电子	11,600	308,676.00	0.11
296	301233	盛帮股份	6,900	306,498.00	0.11
297	605003	众望布艺	15,100	298,074.00	0.11
298	603272	联翔股份	17,400	293,712.00	0.11
299	301156	美农生物	15,400	290,444.00	0.11
300	603709	中源家居	13,540	243,720.00	0.09
301	688981	中芯国际	4,233	224,433.66	0.08
302	600584	长电科技	6,900	206,034.00	0.08
303	603606	东方电缆	4,500	192,375.00	0.07
304	688719	爱科赛博	872	55,637.28	0.02
305	301559	中集环科	2,666	50,115.22	0.02
306	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
307	301526	国际复材	3,454	15,370.30	0.01
308	301510	固高科技	396	13,863.96	0.01
309	301421	波长光电	233	13,833.21	0.01
310	688629	华丰科技	599	13,118.10	0.00
311	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
312	301488	豪恩汽电	180	12,436.20	0.00
313	688627	精智达	139	12,193.08	0.00
314	301370	国科恒泰	689	11,030.89	0.00
315	301558	三态股份	823	11,028.20	0.00
316	688548	广钢气体	819	10,442.25	0.00
317	688563	航材股份	164	9,920.36	0.00
318	301499	维科精密	334	9,662.62	0.00
319	688549	中巨芯	1,190	9,627.10	0.00
320	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
321	301372	科净源	217	9,459.03	0.00
322	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
323	688592	司南导航	184	9,297.52	0.00
324	301509	金凯生科	141	8,774.43	0.00
325	688652	京仪装备	167	8,725.75	0.00
326	688582	芯动联科	225	8,700.75	0.00
327	301362	民爆光电	215	8,281.80	0.00
328	688591	泰凌微	295	8,265.90	0.00
329	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
330	301508	中机认检	307	8,190.76	0.00
331	301507	民生健康	514	8,146.90	0.00
332	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
333	688603	天承科技	108	8,007.12	0.00

334	688653	康希通信	492	7,867.08	0.00
335	688620	安凯微	652	7,706.64	0.00
336	301261	恒工精密	147	7,474.95	0.00
337	301533	威马农机	222	7,361.52	0.00
338	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
339	688651	盛邦安全	156	7,183.80	0.00
340	301295	美硕科技	215	7,135.85	0.00
341	688702	盛科通信	148	7,130.64	0.00
342	301511	德福科技	314	7,118.38	0.00
343	301489	思泉新材	110	7,052.10	0.00
344	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
345	601096	宏盛华源	1,698	6,893.88	0.00
346	301568	思泰克	191	6,795.78	0.00
347	301251	威尔高	193	6,675.87	0.00
348	301459	丰茂股份	167	6,653.28	0.00
349	301517	陕西华达	152	6,640.88	0.00
350	301519	舜禹股份	325	6,568.25	0.00
351	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
352	301418	协昌科技	129	6,475.80	0.00
353	301486	致尚科技	136	6,426.00	0.00
354	301393	昊帆生物	108	6,411.96	0.00
355	301528	多浦乐	92	6,339.72	0.00
356	688631	莱斯信息	176	6,204.00	0.00
357	301550	斯菱股份	142	6,186.94	0.00
358	301202	朗威股份	192	6,105.60	0.00
359	688716	中研股份	158	5,749.62	0.00
360	301456	盘古智能	189	5,743.71	0.00
361	688429	时创能源	254	5,382.26	0.00
362	301515	港通医疗	188	5,314.76	0.00
363	301500	飞南资源	237	4,950.93	0.00
364	688646	逸飞激光	135	4,869.45	0.00
365	301529	福赛科技	126	4,772.88	0.00
366	301520	万邦医药	90	4,746.60	0.00
367	301525	儒竞科技	58	4,724.68	0.00
368	301548	崇德科技	75	4,424.25	0.00
369	301371	敷尔佳	117	4,396.86	0.00
370	688612	威迈斯	113	4,290.61	0.00
371	601083	锦江航运	367	4,062.69	0.00
372	603004	鼎龙科技	126	3,929.94	0.00
373	688450	光格科技	106	3,860.52	0.00
374	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
375	603270	金帝股份	120	3,549.60	0.00
376	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00

377	001306	夏厦精密	42	3,165.12	0.00
378	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
379	001358	兴欣新材	67	2,958.72	0.00
380	603275	众辰科技	72	2,858.40	0.00
381	603119	浙江荣泰	116	2,768.92	0.00
382	603107	上海汽配	148	2,692.12	0.00
383	603193	润本股份	147	2,449.02	0.00
384	603276	恒兴新材	97	2,413.36	0.00
385	603231	索宝蛋白	106	2,282.18	0.00
386	603075	热威股份	87	2,027.97	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000089	深圳机场	3,535,701.00	1.74
2	688029	南微医学	2,893,345.66	1.42
3	002036	联创电子	2,806,448.00	1.38
4	600635	大众公用	2,789,216.00	1.37
5	002891	中宠股份	2,457,973.00	1.21
6	600292	远达环保	2,450,449.00	1.21
7	002126	银轮股份	2,408,052.00	1.18
8	603590	康辰药业	2,342,265.00	1.15
9	002327	富安娜	2,317,896.22	1.14
10	300693	盛弘股份	2,220,651.00	1.09
11	002860	星帅尔	2,195,681.00	1.08
12	688212	澳华内镜	2,092,580.67	1.03
13	002396	星网锐捷	2,061,550.00	1.01
14	603306	华懋科技	2,034,855.20	1.00
15	603308	应流股份	1,965,924.00	0.97
16	603699	纽威股份	1,946,188.00	0.96
17	002006	精工科技	1,941,776.00	0.96
18	300525	博思软件	1,912,070.39	0.94
19	300856	科思股份	1,905,934.90	0.94
20	002807	江阴银行	1,903,074.00	0.94

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688029	南微医学	3,444,292.03	1.69
2	300856	科思股份	2,456,066.90	1.21
3	600635	大众公用	2,449,032.00	1.20
4	688212	澳华内镜	2,441,541.93	1.20
5	300624	万兴科技	2,359,471.00	1.16
6	002318	久立特材	2,287,822.00	1.13
7	603876	鼎胜新材	2,273,512.00	1.12
8	300394	天孚通信	2,159,532.00	1.06
9	600694	大商股份	2,099,675.00	1.03
10	603300	华铁应急	2,067,914.00	1.02
11	002832	比音勒芬	1,994,373.00	0.98
12	300779	惠城环保	1,980,067.00	0.97
13	002126	银轮股份	1,964,506.00	0.97
14	688019	安集科技	1,956,905.00	0.96
15	300693	盛弘股份	1,895,623.00	0.93
16	002807	江阴银行	1,869,339.00	0.92
17	002281	光迅科技	1,848,800.00	0.91
18	002396	星网锐捷	1,826,366.00	0.90
19	002588	史丹利	1,820,666.00	0.90
20	600850	电科数字	1,817,506.00	0.89

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	640,284,741.98
卖出股票收入（成交）总额	621,844,821.43

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,044.75
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,366,349.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,374,393.77

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
南方大数据 300 指数 A	34,652	4,886.62	29,755,198. 63	17.57%	139,575,822 .77	82.43%
南方大数据 300 指数 C	27,932	1,062.62	-	-	29,681,062. 87	100.00%
合计	62,584	3,179.92	29,755,198. 63	14.95%	169,256,885 .64	85.05%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方大数据 300 指数 A	89,668.14	0.0530%

	南方大数据 300 指数 C	-	-
	合计	89,668.14	0.0451%

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方大数据 300 指数 A	0
	南方大数据 300 指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方大数据 300 指数 A	0~10
	南方大数据 300 指数 C	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方大数据 300 指数 A	南方大数据 300 指数 C
基金合同生效日(2015 年 6 月 24 日)基金份额总额	1,874,441,043.18	240,559,049.56
本报告期期初基金份额总额	139,996,575.71	27,141,654.46
本报告期基金总申购份额	45,985,948.33	12,811,438.50
减：报告期基金总赎回份额	16,651,502.64	10,272,030.09
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	169,331,021.40	29,681,062.87

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务 9 年，本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 40,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	3	430,508,619.87	34.35%	43,106.21	7.11%	-
申万宏源	2	375,714,946.13	29.98%	158,405.80	26.14%	-
东吴证券	1	150,396,585.74	12.00%	140,758.77	23.23%	-
中金公司	1	145,693,194.44	11.63%	134,224.65	22.15%	-
中信建投	1	134,604,416.63	10.74%	125,965.89	20.79%	-
中泰证券	1	10,953,553.18	0.87%	1,244.05	0.21%	-
招商证券	1	2,508,338.48	0.20%	285.58	0.05%	-
国泰君安	1	771,342.89	0.06%	710.63	0.12%	-
长江证券	1	760,629.37	0.06%	711.89	0.12%	-
银河证券	1	495,995.82	0.04%	208.92	0.03%	-
开源证券	1	354,803.85	0.03%	332.07	0.05%	-

兴业证券	1	238,640.16	0.02%	23.70	0.00%	-
国投证券	2	118,014.94	0.01%	11.78	0.00%	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	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：

长城证券

长江证券

川财证券

第一创业

东吴证券

光大证券

国金证券

国泰君安

国投证券

海通证券

华安证券

华泰证券

开源证券

申万宏源

兴业证券

银泰证券

招商证券

中金财富

中泰证券

中信建投

中信证券

退租交易单元：

无

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	544,965.23	24.79%	-	-	-	-
申万宏源	1,285,278.33	58.48%	-	-	-	-
东吴证券	200,600.62	9.13%	-	-	-	-
中金公司	167,114.80	7.60%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

川财证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金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	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	2023-03-01
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证券的关联交易公告	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	2023-03-22
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	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	2023-03-23
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	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	2023-03-29
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	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	2023-04-15
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	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	2023-04-20
7	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	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	2023-04-29
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	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	2023-05-10
9	南方基金关于旗下部分基金增加中国工商银行作为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-05-18
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	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	2023-06-03
11	南方基金关于旗下部分基金增加东方证券为销	上海证券报、基金管	2023-06-06

	售机构及开通相关业务的公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	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	2023-06-15
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	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	2023-06-21
14	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	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	2023-07-21
15	南方基金关于旗下部分基金增加博时财富为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-07-25
16	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	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	2023-08-03
17	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	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	2023-08-18
18	南方基金管理股份有限公司关于运用自有资金投资旗下基金的公告	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	2023-08-21
19	南方基金管理股份有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	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	2023-09-07
20	南方基金管理股份有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	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	2023-09-07
21	南方基金管理股份有限公司关于运用自有资金投资旗下权益类公募基金的公告	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	2023-11-03
22	南方基金关于旗下部分基金增加江苏银行为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-11-13
23	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	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	2023-12-01
24	南方基金关于旗下部分基金增加微众银行为销售机构及开通相关业务的公告	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	2023-12-11
25	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	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	2023-12-13

26	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	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	2023-12-15
27	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方华泰联合证券承销证券的关联交易公告	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	2023-12-23
28	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方兴业证券承销证券的关联交易公告	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	2023-12-23

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方大数据 300 指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方大数据 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方大数据 300 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、《南方大数据 300 指数证券投资基金 2023 年年度报告》原文。

13.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>