

财通沪深 300 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:财通基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 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、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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至2023年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	73
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.....	73
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.....	73
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.....	73

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	73
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	73
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
7.12 投资组合报告附注	74
§8 基金份额持有人信息	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
8.3 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	75
§9 开放式基金份额变动	75
§10 重大事件揭示	76
10.1 基金份额持有人大会决议	76
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	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
10.4 基金投资策略的改变	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
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	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
10.8 其他重大事件	79
§11 影响投资者决策的其他重要信息	81
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	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§12 备查文件目录	81
12.1 备查文件目录	81
12.2 存放地点	81
12.3 查阅方式	82

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通沪深300指数增强型证券投资基金
基金简称	财通沪深300指数增强
场内简称	-
基金主代码	005850
交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年12月21日
基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	575,378,996.58份
基金合同存续期	不定期

注：自2022年12月21日起，“财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金”的基金名称变更为“财通沪深300指数增强型证券投资基金”，并正式实施基金转型。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过8%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。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，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。固定收益投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、

	<p>信用风险管理和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场 and 期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。若相关法律法规发生变化时，基金管理人股票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金是股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，跟踪沪深300指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p>

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	财通基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	方斌	石立平
	联系电话	021-20537888	010-63639180
	电子邮箱	service@ctfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-820-9888	95595
传真		021-68888169	010-63639132
注册地址		上海市虹口区吴淞路619号505室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45楼	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		200120	100033
法定代表人		吴林惠	王江

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ctfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财通基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期
	(2023年01月01日- 2023年06月30日)
本期已实现收益	-6,616,868.29

本期利润	-33,525,475.68
加权平均基金份额本期利润	-0.0915
本期加权平均净值利润率	-6.19%
本期基金份额净值增长率	0.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)
期末可供分配利润	254,723,909.23
期末可供分配基金份额利润	0.4427
期末基金资产净值	833,281,602.43
期末基金份额净值	1.4482
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	0.86%

注：(1)所述基金业绩指标不包括持有人认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)期末可供分配利润为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(为期末余额，不是当期发生数)。

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	2.36%	0.83%	1.10%	0.83%	1.26%	0.00%
过去三个月	-4.04%	0.74%	-4.88%	0.79%	0.84%	-0.05%
过去六个月	0.56%	0.75%	-0.69%	0.80%	1.25%	-0.05%
自基金合同生效起至今	0.86%	0.73%	0.36%	0.78%	0.50%	-0.05%

注：(1)上述基金业绩指标不包括持有人认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)本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

3.2.2 自基金转型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



注：(1)根据本基金基金份额持有人大会表决结果，本基金自2022年12月21日起转型为财通沪深300指数增强型证券投资基金，基金转型日至报告期末不满一年；

(2)本基金建仓期是合同生效日起6个月，截至建仓期末和本报告期末，本基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

§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

财通基金管理有限公司成立于2011年6月，由财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江瀚叶股份有限公司共同发起设立，财通证券股份有限公司为第一大股东，出资比例40%。公司注册资本2亿元人民币，注册地上海，经营范围为基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。

财通基金始终秉承“持有人利益至上”的核心价值观，致力于为客户提供专业优质的资产管理服务。在公募业务方面，公司坚持以客户利益为出发点设计产品，逐步建立起覆盖各种投资标的、各种风险收益特征的产品线，获得一定市场口碑；公司将特定客户资产管理业务作为重要发展战略之一，形成玉泉系列、富春系列等多个子品牌，产品具有追求绝对收益、标的丰富、方案灵活等特点，为机构客户、高端个人客户提供个性化的理财选择。

截至2023年6月30日，公司员工共计228人，管理人员和主要业务骨干的证券、基金从业平均年限在13年以上。通过提供多维度、人性化的客户服务，财通基金始终与持有人保持信息透明；通过建立完备的风险控制体系，财通基金最大限度地保证客户的利益。公司将以专业的投资能力、规范的公司治理、诚信至上的服务、力求创新的精神为广大投资者创造价值。

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		
朱海东	量化投资部副总经理（主持工作）、本基金的基金经理	2019-07-16	-	11年	复旦大学基础数学硕士。历任银河基金管理有限公司量化研究员，平安资产管理有限责任公司研究经理。2019年6月加入财通基金管理有限公司，曾任量化投资部基金经理、总经理助理，现任量化投资部副总经理（主持工作）、基金经理。

注：(1)基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

(2)非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

(3)证券从业的含义遵从行业协会《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》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人以价值投资为理念，致力于建设合理的组织架构和科学的投资决策体系，营造公平交易的执行环境。公司通过严格的内控制度和授权体系，确保投资、研究、交易等各个环节的独立性。公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易，并建立了公平的交易分配制度，确保在场内、场外各类交易中，各投资组合都享有公平的交易执行机会。

同时，公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库，在此平台上共享研究成果，并对各组合提供无倾向性支持；在公用备选库的基础上，各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库，进而根据投资授权构建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上，形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中适当启用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后等环节，特殊情况会经过严格的报告和审批程序，会定期针对旗下所有组合的交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析，以排查异常交易。

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，未发现组合间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本投资组合为开放式基金。本报告期内，本投资组合的主动型投资部分与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况，也未发生影响市场价格的临近日同向或反向交易。

经过事前制度约束、事中严密监控，以及事后的统计排查，本报告期内各笔交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明，本期基金运作未对市场产生有违公允性的影响，亦未发现本基金存在异常交易行为。

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

报告期内，本基金组合采用类行业中性配置，控制行业暴露在较低范围之内，同时控制组合相对市场主流风格如大小盘、价值、成长等的暴露，采用量化模型在行业内优选个股，分散持仓，力争追求相对基准的长期稳定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，财通沪深300指数增强基金份额净值为1.4482元，基金份额净值增长率为0.56%，同期业绩比较基准收益率为-0.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上季度末，我们表达了对二季度的预期不如一季度这么乐观，需要更谨慎一些的观点。从事后看，二季度沪深300下跌5.15%，中证1000下跌3.98%，基本符合预期。

展望三季度，我们认为

从目前的政策有定力，经济窄幅震荡的现实来看，经济无明显下滑，无政策刺激出台的可能性较大。因此指数层面我们认为三季度或将维持震荡格局不变。四季度存在估值切换以及更强的政策预期，届时或有更乐观的估计。

行业层面，上季度我们认为对于已经出现拥挤交易的板块可以且战且退，事后看万得AI相关指数季度皆收跌。对于估值在合理中枢，景气度并未拐头向下的板块，会是我们重点考虑的方向。

三季度我们仍将重点考虑代表产业升级方向，同时渗透率较低，产业周期已从底部走出的半导体各细分板块以及经济复苏的先头兵消费板块。这两个板块的组合代表了产业升级+经济复苏的预期。

成长板块在三季度从来都是且战且退的节奏，到了四季度如面临更强的政策预期，甚至会承压。因此在三季度内，随着时间衰减，我们会越来越不考虑终局思维给个股定价。

整体而言，我们认为三季度大概率维持震荡格局。在此观点下，我们需要把更多精力放在Alpha的挖掘上。那些能深入调研行业信息，或者如量化能用程序化手段较快处理大规模数据信息的投资，力争获取较好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票指数的通知》《关于固定收益品种的估值处理标准》《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》和《资产管理产品相关会计处理规定》等法律法规、自律规则等设立公司估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会成员由总经理、督察长、投研部门分管领导、基金清算部门分管领导、基金投资部、专户投资部、固收投资部、量化投资部、研究部、风险管理部、法律合规部、基金清算部等部门负责人、基金清算部相关业务人员、涉及的相关基金经理或投资经理或实际履行前述部门相当职责的部门负责人或人员组成。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用、风险管理等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力。如果基金经理认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序、确定调整/暂停估值方案，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司于2013年9月签订了《基金估值核算业务外包协议》，与中国工商银行股份有限公司上海市分行于2018年6月签订了《基金行政外包协议》，与中信中证投资服务有限责任公司于2019年7月签订了《行政管理服务协议》，与申万宏源证券有限公司于2019年9月签订了《运营服务合同》、于2020年5月签订了《基金运营服务合同》。截至报告期末，基金管理人对旗下部分特定客户资产管理计划估值业务实行外包。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：转型为指数型基金后，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未有连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

§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，中国光大银行股份有限公司在财通沪深300指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《财通沪深300指数增强型证券投资基金2023年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：财通沪深300指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	61,558,297.98	12,772,400.85
结算备付金		5,534,094.15	436,186.04
存出保证金		2,758,449.60	61,696.81
交易性金融资产	6.4.7.2	766,042,687.28	163,862,953.36
其中：股票投资		766,042,687.28	163,862,953.36
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		-	931,687.80
应收股利		-	-
应收申购款		513,185.78	119,040.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		836,406,714.79	178,183,965.03
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	4,472,033.29
应付赎回款		1,367,550.30	692.09
应付管理人报酬		1,070,726.23	207,909.81
应付托管费		178,454.39	34,651.61
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	508,381.44	549,327.60
负债合计		3,125,112.36	5,264,614.40
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	575,378,996.58	120,071,391.10
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	257,902,605.85	52,847,959.53
净资产合计		833,281,602.43	172,919,350.63
负债和净资产总计		836,406,714.79	178,183,965.03

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额净值1.4482元，基金份额总额575,378,996.58份。

6.2 利润表

会计主体：财通沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2023年0 6月30日
一、营业总收入		-28,724,932.87

1.利息收入		124,071.94
其中：存款利息收入	6.4.7.9	124,071.94
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,156,638.88
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-9,576,414.93
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-3,091.80
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-2,098,582.06
股利收益	6.4.7.13	9,521,449.91
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）	6.4.7.14	-26,908,607.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	216,241.46
减：二、营业总支出		4,800,542.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,042,255.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	673,709.21
3. 销售服务费		-
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	6.4.7.16	-
7. 税金及附加		275.83

8. 其他费用	6.4.7.17	84,302.56
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-33,525,475.68
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-33,525,475.68
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-33,525,475.68

注: 本基金于2022年12月21日转型, 无比较式的上年度数据。

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体: 财通沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期: 2023年01月01日至2023年06月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	120,071,391.10	-	52,847,959.53	172,919,350.63
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	120,071,391.10	-	52,847,959.53	172,919,350.63
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	455,307,605.48	-	205,054,646.32	660,362,251.80
(一)、综合收益总额	-	-	-33,525,475.68	-33,525,475.68
(二)、本期基	455,307,605.48	-	238,580,122.00	693,887,727.48

金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	988,372,846.66	-	503,944,048.42	1,492,316,895.08
2.基金赎回款	-533,065,241.18	-	-265,363,926.42	-798,429,167.60
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	575,378,996.58	-	257,902,605.85	833,281,602.43

注：本基金于2022年12月21日转型，无比较式的上年度数据。

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：

徐春庭

刘为臻

刘为臻

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 基金基本情况

财通沪深300指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）由财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金转型而成，财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金系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[2018]540号文《关于准予财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人财通基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2019年1月30日生效，首

次设立募集规模为458,980,142.88份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据《财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及《财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自2022年12月21日起转型并更名为财通沪深300指数增强型证券投资基金。本基金的基金管理人和注册登记机构为财通基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。其他包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、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、政府支持债券、地方政府债、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（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例不低于80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股占非现金基金资产的比例不低于80%。每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2023年6月30日的财务状况以及2023年01月01日至2023年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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

本基金本报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个体，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	31,823,595.78
等于：本金	31,817,235.79
加：应计利息	6,359.99
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	29,734,702.20
等于：本金	29,731,882.42
加：应计利息	2,819.78
减：坏账准备	-
合计	61,558,297.98

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	793,743,636.49	-	766,042,687.28	-27,700,949.21
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	793,743,636.49	-	766,042,687.28	-27,700,949.21

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	22,987,080.00	-	-	-
--股指期货	22,987,080.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	22,987,080.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2307	沪深300股指期货2	14.00	16,087,680.00	-167,100.00

	307 合约			
IF2308	沪深300股指期货2 308 合约	6.00	6,899,400.00	37,680.00
合计				-129,420.00
减：可抵销 期货暂收 款				-129,420.00
净额				-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用	84,302.56
其他应付	424,078.88
合计	508,381.44

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	120,071,391.10	120,071,391.10
本期申购	988,372,846.66	988,372,846.66
本期赎回（以“-”号填列）	-533,065,241.18	-533,065,241.18
本期末	575,378,996.58	575,378,996.58

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	51,608,262.63	1,239,696.90	52,847,959.53
本期利润	-6,616,868.29	-26,908,607.39	-33,525,475.68
本期基金份额交易产生的变动数	209,732,514.89	28,847,607.11	238,580,122.00
其中：基金申购款	451,178,907.98	52,765,140.44	503,944,048.42
基金赎回款	-241,446,393.09	-23,917,533.33	-265,363,926.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	254,723,909.23	3,178,696.62	257,902,605.85

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
	活期存款利息收入

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	32,181.41
结算备付金利息收入	20,726.47
其他	2,034.25
合计	124,071.94

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	1,374,732,018.83
减：卖出股票成本总额	1,380,164,721.49
减：交易费用	4,143,712.27
买卖股票差价收入	-9,576,414.93

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	1,117.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,209.59
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	-3,091.80

6.4.7.11.2 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01月01日至2023年06月30日

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,084,384.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,002,100.00
减：应计利息总额	85,079.44
减：交易费用	1,414.59
买卖债券差价收入	-4,209.59

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未有债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023年01月01日至2023年06月30日
期货投资	-2,098,582.06

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	9,521,449.91
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	9,521,449.91

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	-26,779,187.39
——股票投资	-26,779,187.39
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-129,420.00
——权证投资	-
——期货投资	-129,420.00
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	-26,908,607.39

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	216,241.46
合计	216,241.46

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	84,302.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本基金本报告期不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。

6.4.9.2 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
财通基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
财通证券股份有限公司（“财通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,042,255.21
其中：支付销售机构的客户维护费	759,334.50

注：(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日计提，按月支付；

(2)基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5% / 当年天数；

(3)客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目；

(4)本基金于2022年12月21日转型，无比较式的上年度数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	673,709.21

注：(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日计提，按月支付；

(2)基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数；

(3)本基金于2022年12月21日转型，无比较式的上年度数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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
无。

6.4.10.4.2 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
无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 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01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	31,823,595.78	69,129.81

注：(1)本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息；
(2)本基金于2022年12月21日转型，无比较式的上年度数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期无其他当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
002812	恩捷股份	2023-06-19	6个月	非公开发行流通受限	87.80	90.65	35,841	3,146,839.80	3,248,986.65	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内（含）	认购新发证券	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内（含）	认购新发证券	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内（含）	认购新发证券	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内（含）	认购新发证券	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内（含）	认购新发证券	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-

688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	新股限售	11.10	17.04	3,409	37,839.90	58,089.36	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6个月	新股限售	37.88	29.49	1,630	61,744.40	48,068.70	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新股限售	19.86	18.06	2,444	48,537.84	44,138.64	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月	新股限售	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月	新股限售	38.13	31.03	1,117	42,591.21	34,660.51	-
688576	西山科技	2023-05-30	6个月	新股限售	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	新股限售	23.60	64.67	416	9,817.60	26,902.72	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月	新股限售	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月	新股限售	76.80	107.95	228	17,510.40	24,612.60	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	新股限售	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	新股限售	5.69	5.41	4,140	23,556.60	22,397.40	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	新股限售	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
6885	国科	2023	6个月	新股	43.67	53.05	410	17,90	21,75	-

43	军工	-06-14		限售				4.70	0.50	
301383	天键股份	2023-05-31	6个月	新股限售	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
688562	航天软件	2023-05-15	6个月	新股限售	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	新股限售	75.00	90.76	174	13,050.00	15,792.24	-
688623	双元科技	2023-05-31	6个月	新股限售	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
301399	英特科技	2023-05-16	6个月	新股限售	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月	新股限售	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
688334	西高院	2023-06-09	6个月	新股限售	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月	新股限售	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股限售	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	新股限售	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	新股限售	21.17	23.50	546	11,558.82	12,831.00	-
688581	安杰思	2023-05-1	6个月	新股限售	125.80	118.03	107	13,460.60	12,629.21	-

		2								
688620	安凯微	2023-06-15	6个月	新股限售	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6个月	新股限售	25.25	19.69	623	15,730.75	12,266.87	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	新股限售	14.81	13.73	849	12,573.69	11,656.77	-
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	新股限售	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	新股限售	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股限售	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
688512	慧智微	2023-05-08	6个月	新股限售	20.92	19.16	534	11,171.28	10,231.44	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	新股限售	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	新股限售	152.38	135.97	70	10,666.60	9,517.90	-
301307	美利信	2023-04-14	6个月	新股限售	32.34	31.86	298	9,637.32	9,494.28	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	新股限售	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023-06-02	6个月	新股限售	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-

688479	友车科技	2023-05-04	6个月	新股限售	33.99	29.49	305	10,366.95	8,994.45	-
301387	光大同创	2023-04-10	6个月	新股限售	58.32	45.36	198	11,547.36	8,981.28	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	新股限售	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	6个月	新股限售	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6个月	新股限售	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6个月	新股限售	41.20	42.69	202	8,322.40	8,623.38	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月	新股限售	28.75	21.02	394	11,327.50	8,281.88	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股限售	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股限售	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股限售	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股限售	11.88	21.02	342	4,062.96	7,188.84	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	新股限售	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
3014	世纪	2023	6个月	新股	26.35	30.60	229	6,03	7,00	-

28	恒通	-05-10		限售				4.15	7.40	
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	新股限售	26.66	31.50	209	5,571.94	6,583.50	-
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	新股限售	44.18	25.10	173	7,643.14	4,342.30	-
301281	科源制药	2023-05-26	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	25.10	69	-	1,731.90	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月	新股限售	17.80	17.89	224	3,987.20	4,007.36	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股限售	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股限售	10.36	11.84	277	2,869.72	3,279.68	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月	新股限售	11.66	12.26	242	2,821.72	2,966.92	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月	新股限售	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股限售	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股限售	15.38	14.87	148	2,276.24	2,200.76	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股限售	44.48	39.48	47	2,090.56	1,855.56	-

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险的防范和控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规控制委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作，公司下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的监察稽核部和风险管理部，两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控。

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。

6.4.13.2 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建立了信用风险管理流程，通过对各类投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国光大银行，按银行同业利率计息，与该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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时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。

6.4.13.3.1 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日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，并对基金组合资产中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，确保每日确认的净赎回申请不超过7个工作日可变现资产的可变现价值，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带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大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，因此除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时

变现。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资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款，结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	61,558,297.98	-	-	-	-	-	61,558,297.98
结算备付金	2,090.31	-	-	-	-	5,532,003.84	5,534,094.15
存出保证金	2,758,449.60	-	-	-	-	-	2,758,449.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	766,042,687.28	766,042,687.28
应收	49,992.50	-	-	-	-	463,193.28	513,185.78

申购款							
资产总计	64,368,830.39	-	-	-	-	772,037,884.40	836,406,714.79
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,367,550.30	1,367,550.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,070,726.23	1,070,726.23
应付托管费	-	-	-	-	-	178,454.39	178,454.39
其他负债	-	-	-	-	-	508,381.44	508,381.44
负债总计	-	-	-	-	-	3,125,112.36	3,125,112.36
利率敏感度缺口	64,368,830.39	-	-	-	-	768,912,772.04	833,281,602.43
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	12,772,400.85	-	-	-	-	-	12,772,400.85
结算备付金	436,186.04	-	-	-	-	-	436,186.04
存出保证金	61,696.81	-	-	-	-	-	61,696.81
交易性金	-	-	-	-	-	163,862,953.36	163,862,953.36

融资产							
应收清算款	-	-	-	-	-	931,687.80	931,687.80
应收申购款	-	-	-	-	-	119,040.17	119,040.17
资产总计	13,270,283.70	-	-	-	-	164,913,681.33	178,183,965.03
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	4,472,033.29	4,472,033.29
应付赎回款	-	-	-	-	-	692.09	692.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	207,909.81	207,909.81
应付托管费	-	-	-	-	-	34,651.61	34,651.61
其他负债	-	-	-	-	-	549,327.60	549,327.60
负债总计	-	-	-	-	-	5,264,614.40	5,264,614.40
利率敏感度缺口	13,270,283.70	-	-	-	-	159,649,066.93	172,919,350.63

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末未持有交易性固定收益类投资（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要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证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以价值投资为核心，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例为0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%，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，现金或者到期日在一年以内的政府债券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。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	766,042,687.28	91.93	163,862,953.36	94.76
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-

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	766,042,687.28	91.93	163,862,953.36	94.76

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。		
	2.除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
	3.贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。		
	4.业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。		
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06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准增加1%	7,558,519.53	1,674,778.00
	业绩比较基准减少1%	-7,558,519.53	-1,674,778.00

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
---------------	--------------------	---------------------

第一层次	761,507,589.47	157,902,286.93
第二层次	423,888.14	-
第三层次	4,111,209.67	5,960,666.43
合计	766,042,687.28	163,862,953.36

6.4.14.2 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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

2、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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	766,042,687.28	91.59
	其中：股票	766,042,687.28	91.59
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	67,092,392.13	8.02
8	其他各项资产	3,271,635.38	0.39
9	合计	836,406,714.79	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,651,270.00	0.80
B	采矿业	23,101,415.63	2.77
C	制造业	302,844,556.14	36.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,344,870.00	1.48
E	建筑业	20,998,818.60	2.52
F	批发和零售业	997,510.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	8,872,469.00	1.06
H	住宿和餐饮业	1,922,236.00	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,493,630.38	4.38
J	金融业	161,662,192.54	19.40
K	房地产业	21,441,589.00	2.57
L	租赁和商务服务业	16,864,213.55	2.02
M	科学研究和技术服务业	1,133,621.70	0.14
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	816.20	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,337,611.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	616,666,819.74	74.00

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	724,945.00	0.09
B	采矿业	12,456,339.00	1.49
C	制造业	86,339,470.58	10.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,310,831.50	0.64
E	建筑业	9,403.43	0.00
F	批发和零售业	10,427,075.79	1.25
G	交通运输、仓储和邮政业	2,195,580.00	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,975,964.97	0.96
J	金融业	4,111,995.20	0.49
K	房地产业	1,687,836.00	0.20
L	租赁和商务服务业	5,048,841.00	0.61
M	科学研究和技术服务业	2,402,536.34	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	13,540.87	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,713,737.86	0.33
R	文化、体育和娱乐业	7,957,770.00	0.95
S	综合	-	-

合计	149,375,867.54	17.93
----	----------------	-------

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通过港股通机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

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	600036	招商银行	1,355,100	44,393,076.00	5.33
2	601318	中国平安	701,946	32,570,294.40	3.91
3	000651	格力电器	759,221	27,719,158.71	3.33
4	000568	泸州老窖	101,416	21,253,751.12	2.55
5	601166	兴业银行	1,071,300	16,765,845.00	2.01
6	600519	贵州茅台	9,415	15,920,765.00	1.91
7	600690	海尔智家	559,300	13,132,364.00	1.58
8	600050	中国联通	2,728,500	13,096,800.00	1.57
9	300760	迈瑞医疗	40,517	12,146,996.60	1.46
10	002142	宁波银行	469,500	11,878,350.00	1.43
11	601601	中国太保	429,300	11,153,214.00	1.34
12	000063	中兴通讯	242,900	11,061,666.00	1.33
13	601888	中国中免	95,846	10,593,858.38	1.27
14	601390	中国中铁	1,271,100	9,634,938.00	1.16
15	603369	今世缘	160,515	8,475,192.00	1.02
16	300124	汇川技术	129,236	8,298,243.56	1.00
17	600809	山西汾酒	42,793	7,919,700.51	0.95
18	300750	宁德时代	34,320	7,852,072.80	0.94
19	601618	中国中冶	1,891,400	7,508,858.00	0.90
20	601985	中国核电	1,035,300	7,298,865.00	0.88

21	600383	金地集团	988,200	7,124,922.00	0.86
22	603288	海天味业	149,892	7,022,440.20	0.84
23	002714	牧原股份	157,800	6,651,270.00	0.80
24	002027	分众传媒	920,757	6,270,355.17	0.75
25	603833	欧派家居	65,200	6,246,160.00	0.75
26	600048	保利发展	465,600	6,066,768.00	0.73
27	002555	三七互娱	172,600	6,020,288.00	0.72
28	000002	万科 A	423,100	5,931,862.00	0.71
29	002050	三花智控	193,900	5,867,414.00	0.70
30	601728	中国电信	1,029,400	5,795,522.00	0.70
31	603185	上机数控	73,700	5,494,335.00	0.66
32	601688	华泰证券	394,100	5,426,757.00	0.65
33	601899	紫金矿业	472,099	5,367,765.63	0.64
34	600660	福耀玻璃	149,000	5,341,650.00	0.64
35	600188	兖矿能源	178,100	5,328,752.00	0.64
36	600436	片仔癀	17,800	5,097,208.00	0.61
37	002049	紫光国微	50,200	4,681,150.00	0.56
38	601881	中国银河	402,300	4,670,703.00	0.56
39	600030	中信证券	229,375	4,537,037.50	0.54
40	000776	广发证券	307,000	4,515,970.00	0.54
41	002736	国信证券	517,200	4,515,156.00	0.54
42	601211	国泰君安	320,100	4,478,199.00	0.54
43	601766	中国中车	638,567	4,150,685.50	0.50
44	601336	新华保险	112,400	4,132,948.00	0.50
45	600028	中国石化	648,600	4,125,096.00	0.50
46	601319	中国人保	697,981	4,076,209.04	0.49
47	000977	浪潮信息	78,400	3,802,400.00	0.46
48	601919	中远海控	404,300	3,800,420.00	0.46
49	002709	天赐材料	90,300	3,719,457.00	0.45
50	600893	航发动力	88,000	3,718,880.00	0.45
51	600845	宝信软件	70,060	3,559,748.60	0.43

52	600760	中航沈飞	77,600	3,492,000.00	0.42
53	601857	中国石油	454,100	3,392,127.00	0.41
54	601689	拓普集团	41,600	3,357,120.00	0.40
55	002410	广联达	102,500	3,330,225.00	0.40
56	002271	东方雨虹	120,540	3,285,920.40	0.39
57	002812	恩捷股份	35,841	3,248,986.65	0.39
58	600600	青岛啤酒	31,000	3,212,530.00	0.39
59	600741	华域汽车	173,000	3,193,580.00	0.38
60	300122	智飞生物	71,500	3,160,300.00	0.38
61	601225	陕西煤业	159,500	2,901,305.00	0.35
62	601633	长城汽车	110,100	2,771,217.00	0.33
63	300316	晶盛机电	38,500	2,729,650.00	0.33
64	000895	双汇发展	107,900	2,642,471.00	0.32
65	601877	正泰电器	91,300	2,524,445.00	0.30
66	300896	爱美客	5,600	2,491,720.00	0.30
67	600085	同仁堂	42,600	2,452,056.00	0.29
68	002920	德赛西威	15,000	2,337,150.00	0.28
69	601669	中国电建	406,600	2,333,884.00	0.28
70	001979	招商蛇口	177,900	2,318,037.00	0.28
71	002311	海大集团	49,100	2,299,844.00	0.28
72	000733	振华科技	22,900	2,194,965.00	0.26
73	600460	士兰微	72,100	2,182,467.00	0.26
74	000876	新希望	184,800	2,158,464.00	0.26
75	300661	圣邦股份	26,240	2,155,091.20	0.26
76	000333	美的集团	36,200	2,132,904.00	0.26
77	600176	中国巨石	150,371	2,129,253.36	0.26
78	688599	天合光能	48,851	2,081,541.11	0.25
79	000425	徐工机械	304,400	2,060,788.00	0.25
80	600754	锦江酒店	45,400	1,922,236.00	0.23
81	688111	金山办公	3,899	1,841,185.78	0.22
82	600111	北方稀土	74,600	1,788,908.00	0.21

83	601100	恒立液压	26,800	1,724,044.00	0.21
84	605499	东鹏饮料	9,200	1,590,680.00	0.19
85	603899	晨光股份	34,100	1,522,224.00	0.18
86	600039	四川路桥	155,060	1,521,138.60	0.18
87	603486	科沃斯	19,500	1,516,515.00	0.18
88	600019	宝钢股份	263,548	1,481,139.76	0.18
89	603392	万泰生物	22,120	1,476,952.40	0.18
90	601838	成都银行	120,700	1,473,747.00	0.18
91	600309	万华化学	16,700	1,466,928.00	0.18
92	600233	圆通速递	100,100	1,457,456.00	0.17
93	600426	华鲁恒升	46,890	1,436,240.70	0.17
94	300999	金龙鱼	35,600	1,423,644.00	0.17
95	000786	北新建材	57,700	1,414,227.00	0.17
96	300413	芒果超媒	39,100	1,337,611.00	0.16
97	002415	海康威视	39,800	1,317,778.00	0.16
98	600674	川投能源	86,200	1,297,310.00	0.16
99	600031	三一重工	74,181	1,233,630.03	0.15
100	601288	农业银行	348,200	1,229,146.00	0.15
101	600010	包钢股份	657,700	1,177,283.00	0.14
102	600438	通威股份	33,400	1,145,954.00	0.14
103	300628	亿联网络	32,260	1,131,358.20	0.14
104	300759	康龙化成	29,500	1,129,260.00	0.14
105	002493	荣盛石化	95,800	1,115,112.00	0.13
106	600000	浦发银行	150,900	1,092,516.00	0.13
107	600089	特变电工	49,000	1,092,210.00	0.13
108	600061	国投资本	153,300	1,091,496.00	0.13
109	000338	潍柴动力	85,100	1,060,346.00	0.13
110	600919	江苏银行	144,200	1,059,870.00	0.13
111	600803	新奥股份	55,300	1,049,594.00	0.13
112	002179	中航光电	22,000	997,700.00	0.12
113	000963	华东医药	23,000	997,510.00	0.12

114	601872	招商轮船	170,000	984,300.00	0.12
115	600018	上港集团	180,200	946,050.00	0.11
116	601009	南京银行	117,000	936,000.00	0.11
117	002938	鹏鼎控股	38,200	927,878.00	0.11
118	002129	TCL中环	27,900	926,280.00	0.11
119	600926	杭州银行	76,800	902,400.00	0.11
120	000538	云南白药	17,000	892,160.00	0.11
121	002236	大华股份	44,600	880,850.00	0.11
122	601021	春秋航空	15,300	879,291.00	0.11
123	600886	国投电力	67,700	856,405.00	0.10
124	300433	蓝思科技	72,700	854,952.00	0.10
125	601600	中国铝业	155,500	853,695.00	0.10
126	600011	华能国际	91,700	849,142.00	0.10
127	600362	江西铜业	44,400	842,712.00	0.10
128	600989	宝丰能源	66,800	842,348.00	0.10
129	600025	华能水电	118,000	841,340.00	0.10
130	601898	中煤能源	98,100	827,964.00	0.10
131	601698	中国卫通	41,400	823,032.00	0.10
132	601012	隆基绿能	28,483	816,607.61	0.10
133	002120	韵达股份	84,200	804,952.00	0.10
134	000301	东方盛虹	65,500	774,210.00	0.09
135	601998	中信银行	126,700	757,666.00	0.09
136	300979	华利集团	15,400	750,596.00	0.09
137	000877	天山股份	88,000	716,320.00	0.09
138	603019	中科曙光	13,800	702,420.00	0.08
139	000938	紫光股份	21,800	694,330.00	0.08
140	300454	深信服	6,000	679,500.00	0.08
141	600588	用友网络	33,100	678,550.00	0.08
142	002601	龙佰集团	40,700	671,550.00	0.08
143	600570	恒生电子	15,100	668,779.00	0.08
144	002371	北方华创	1,955	621,005.75	0.07

145	688008	澜起科技	10,700	614,394.00	0.07
146	002756	永兴材料	9,750	610,447.50	0.07
147	600732	爱旭股份	19,780	608,235.00	0.07
148	603986	兆易创新	5,700	605,625.00	0.07
149	603501	韦尔股份	6,170	604,906.80	0.07
150	600584	长电科技	19,400	604,698.00	0.07
151	688012	中微公司	3,864	604,522.80	0.07
152	002180	纳思达	17,600	602,800.00	0.07
153	601699	潞安环能	36,800	600,576.00	0.07
154	300782	卓胜微	6,200	599,106.00	0.07
155	688303	大全能源	14,800	598,660.00	0.07
156	688126	沪硅产业	28,542	596,527.80	0.07
157	688981	中芯国际	11,783	595,277.16	0.07
158	688223	晶科能源	42,300	594,738.00	0.07
159	688396	华润微	11,338	594,224.58	0.07
160	002459	晶澳科技	14,220	592,974.00	0.07
161	300223	北京君正	6,700	591,677.00	0.07
162	000723	美锦能源	78,400	591,136.00	0.07
163	603806	福斯特	15,880	590,577.20	0.07
164	603260	合盛硅业	8,300	581,166.00	0.07
165	688187	时代电气	13,800	577,668.00	0.07
166	000983	山西焦煤	61,300	557,830.00	0.07
167	000858	五粮液	3,310	541,416.70	0.06
168	000708	中信特钢	26,600	421,344.00	0.05
169	002594	比亚迪	800	206,616.00	0.02
170	300763	锦浪科技	1,800	187,380.00	0.02
171	000157	中联重科	23,000	155,250.00	0.02
172	600900	长江电力	6,900	152,214.00	0.02
173	605117	德业股份	600	89,730.00	0.01
174	600276	恒瑞医药	1,852	88,710.80	0.01
175	300769	德方纳米	720	79,365.60	0.01

176	600887	伊利股份	200	5,664.00	0.00
177	688363	华熙生物	63	5,617.08	0.00
178	603259	药明康德	70	4,361.70	0.00
179	601628	中国人寿	100	3,496.00	0.00
180	688036	传音控股	23	3,381.00	0.00
181	002648	卫星化学	220	3,291.20	0.00
182	601939	建设银行	210	1,314.60	0.00
183	300015	爱尔眼科	44	816.20	0.00
184	601988	中国银行	200	782.00	0.00
185	002475	立讯精密	15	486.75	0.00

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

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	601717	郑煤机	419,900	5,227,755.00	0.63
2	600096	云天化	282,600	4,823,982.00	0.58
3	601168	西部矿业	455,300	4,785,203.00	0.57
4	000933	神火股份	365,600	4,752,800.00	0.57
5	002080	中材科技	222,600	4,567,752.00	0.55
6	000893	亚钾国际	193,900	4,448,066.00	0.53
7	600566	济川药业	151,400	4,396,656.00	0.53
8	000785	居然之家	1,149,100	4,378,071.00	0.53
9	600373	中文传媒	323,000	4,302,360.00	0.52
10	600968	海油发展	1,383,400	4,247,038.00	0.51
11	601158	重庆水务	757,830	4,213,534.80	0.51
12	600153	建发股份	382,401	4,171,994.91	0.50
13	600901	江苏租赁	993,840	4,104,559.20	0.49
14	600704	物产中大	783,800	3,871,972.00	0.46
15	601928	凤凰传媒	254,100	2,896,740.00	0.35
16	300532	今天国际	136,300	2,802,328.00	0.34

17	002536	飞龙股份	183,600	2,754,000.00	0.33
18	688569	铁科轨道	65,042	2,736,316.94	0.33
19	000921	海信家电	100,500	2,708,475.00	0.33
20	300866	安克创新	30,800	2,695,000.00	0.32
21	301239	普瑞眼科	27,400	2,687,392.00	0.32
22	002478	常宝股份	356,600	2,656,670.00	0.32
23	600612	老凤祥	38,000	2,655,440.00	0.32
24	688551	科威尔	40,300	2,642,874.00	0.32
25	300494	盛天网络	105,400	2,612,866.00	0.31
26	300624	万兴科技	20,900	2,448,435.00	0.29
27	603129	春风动力	15,100	2,444,690.00	0.29
28	002959	小熊电器	28,735	2,399,372.50	0.29
29	301257	普蕊斯	42,300	2,377,260.00	0.29
30	603518	锦泓集团	206,700	2,346,045.00	0.28
31	688112	鼎阳科技	44,281	2,337,151.18	0.28
32	603345	安井食品	15,900	2,334,120.00	0.28
33	600129	太极集团	37,500	2,230,875.00	0.27
34	600197	伊力特	82,000	2,227,940.00	0.27
35	600211	西藏药业	37,500	2,227,500.00	0.27
36	301101	明月镜片	54,200	2,223,826.00	0.27
37	688029	南微医学	27,000	2,202,120.00	0.26
38	601333	广深铁路	536,300	2,123,748.00	0.25
39	603215	比依股份	117,900	2,115,126.00	0.25
40	600985	淮北矿业	165,800	1,910,016.00	0.23
41	002244	滨江集团	138,600	1,222,452.00	0.15
42	002408	齐翔腾达	191,000	1,216,670.00	0.15
43	603596	伯特利	14,200	1,125,492.00	0.14
44	000598	兴蓉环境	193,761	1,052,122.23	0.13
45	002139	拓邦股份	67,600	882,180.00	0.11
46	001339	智微智能	28,500	845,595.00	0.10
47	689009	九号公司	22,500	829,125.00	0.10

48	603368	柳药集团	33,300	822,843.00	0.10
49	002484	江海股份	38,500	819,665.00	0.10
50	601369	陕鼓动力	88,200	803,502.00	0.10
51	603233	大参林	28,220	790,442.20	0.09
52	002533	金杯电工	95,500	779,280.00	0.09
53	600328	中盐化工	86,220	775,980.00	0.09
54	603688	石英股份	6,800	774,112.00	0.09
55	002056	横店东磁	42,200	768,462.00	0.09
56	601958	金钼股份	68,300	761,545.00	0.09
57	002739	万达电影	60,500	758,670.00	0.09
58	002128	电投能源	56,700	749,574.00	0.09
59	000048	京基智农	38,300	747,616.00	0.09
60	600998	九州通	71,828	745,574.64	0.09
61	688100	威胜信息	24,800	739,288.00	0.09
62	002458	益生股份	58,700	724,945.00	0.09
63	002422	科伦药业	24,300	721,224.00	0.09
64	600057	厦门象屿	77,100	670,770.00	0.08
65	603712	七一二	15,300	462,213.00	0.06
66	600007	中国国贸	24,900	461,148.00	0.06
67	600315	上海家化	8,100	234,981.00	0.03
68	300395	菲利华	4,400	216,480.00	0.03
69	002600	领益智造	23,900	165,149.00	0.02
70	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
71	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
72	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
73	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
74	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
75	600026	中远海能	5,600	70,784.00	0.01
76	688472	阿特斯	3,409	58,089.36	0.01
77	688169	石头科技	180	57,722.40	0.01
78	603444	吉比特	98	48,128.78	0.01

79	688443	智翔金泰	1,630	48,068.70	0.01
80	688249	晶合集成	2,444	44,138.64	0.01
81	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
82	301291	明阳电气	1,117	34,660.51	0.00
83	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
84	688361	中科飞测	416	26,902.72	0.00
85	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
86	301325	曼恩斯特	228	24,612.60	0.00
87	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
88	688469	中芯集成	4,140	22,397.40	0.00
89	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
90	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
91	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
92	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
93	688639	华恒生物	178	16,105.44	0.00
94	688458	美芯晟	174	15,792.24	0.00
95	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
96	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
97	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
98	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
99	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
10 0	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
10 1	688552	航天南湖	546	12,831.00	0.00
10 2	688581	安杰思	107	12,629.21	0.00
10 3	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
10 4	301305	朗坤环境	623	12,266.87	0.00
10 5	688390	固德威	72	12,013.92	0.00

10 6	301332	德尔玛	849	11,656.77	0.00
10 7	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
10 8	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
10 9	688512	慧智微	534	10,231.44	0.00
11 0	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
11 1	688531	日联科技	70	9,517.90	0.00
11 2	301307	美利信	298	9,494.28	0.00
11 3	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
11 4	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
11 5	688479	友车科技	305	8,994.45	0.00
11 6	301387	光大同创	198	8,981.28	0.00
11 7	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
11 8	688131	皓元医药	157	8,945.86	0.00
11 9	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
12 0	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
12 1	301141	中科磁业	202	8,623.38	0.00
12 2	301429	森泰股份	394	8,281.88	0.00
12 3	001287	中电港	342	7,188.84	0.00

12 4	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
12 5	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
12 6	688433	华曙高科	209	6,583.50	0.00
12 7	301281	科源制药	242	6,074.20	0.00
12 8	600186	莲花健康	1,600	4,608.00	0.00
12 9	600084	中葡股份	600	4,602.00	0.00
13 0	600116	三峡水利	500	4,540.00	0.00
13 1	603135	中重科技	224	4,007.36	0.00
13 2	301053	远信工业	155	3,932.35	0.00
13 3	301017	漱玉平民	200	3,808.00	0.00
13 4	600774	汉商集团	300	3,798.00	0.00
13 5	001308	康冠科技	130	3,569.80	0.00
13 6	000030	富奥股份	700	3,528.00	0.00
13 7	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
13 8	600835	上海机电	200	3,436.00	0.00
13 8	002430	杭氧股份	100	3,436.00	0.00
14 0	000932	华菱钢铁	700	3,339.00	0.00
14 1	000627	天茂集团	1,100	3,300.00	0.00

14 2	601065	江盐集团	277	3,279.68	0.00
14 3	688009	中国通号	541	3,137.80	0.00
14 4	600705	中航产融	800	3,064.00	0.00
14 5	600820	隧道股份	500	3,005.00	0.00
14 6	600208	新湖中宝	1,200	2,976.00	0.00
14 7	601133	柏诚股份	242	2,966.92	0.00
14 8	000762	西藏矿业	100	2,963.00	0.00
14 9	600066	宇通客车	200	2,948.00	0.00
15 0	002495	佳隆股份	1,100	2,684.00	0.00
15 1	688678	福立旺	126	2,677.50	0.00
15 2	002030	达安基因	260	2,592.20	0.00
15 3	600008	首创环保	900	2,592.00	0.00
15 4	002690	美亚光电	100	2,575.00	0.00
15 5	300244	迪安诊断	100	2,563.00	0.00
15 6	600177	雅戈尔	400	2,524.00	0.00
15 7	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
15 8	300682	朗新科技	100	2,328.00	0.00
15 9	002820	桂发祥	200	2,268.00	0.00

16 0	002396	星网锐捷	100	2,259.00	0.00
16 1	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
16 2	600782	新钢股份	600	2,226.00	0.00
16 3	001360	南矿集团	148	2,200.76	0.00
16 4	002463	沪电股份	100	2,094.00	0.00
16 5	605167	利柏特	200	1,936.00	0.00
16 6	688289	圣湘生物	113	1,902.92	0.00
16 7	001367	海森药业	47	1,855.56	0.00
16 8	002497	雅化集团	100	1,778.00	0.00
16 9	300457	赢合科技	100	1,766.00	0.00
17 0	601231	环旭电子	100	1,496.00	0.00
17 1	600073	上海梅林	200	1,460.00	0.00
17 2	000155	川能动力	100	1,440.00	0.00
17 3	688556	高测股份	27	1,434.78	0.00
17 4	002258	利尔化学	109	1,407.19	0.00
17 5	001318	阳光乳业	100	1,353.00	0.00
17 6	000546	ST金圆	200	1,274.00	0.00
17 7	600773	西藏城投	100	1,260.00	0.00

17 8	600483	福能股份	100	1,155.00	0.00
17 9	600499	科达制造	100	1,136.00	0.00
18 0	600908	无锡银行	200	1,072.00	0.00
18 1	600502	安徽建工	200	1,056.00	0.00
18 1	000957	中通客车	100	1,056.00	0.00
18 3	600012	皖通高速	100	1,048.00	0.00
18 4	603421	鼎信通讯	100	1,045.00	0.00
18 5	002563	森马服饰	113	702.86	0.00
18 6	002085	万丰奥威	100	693.00	0.00
18 7	688698	伟创电气	1	39.98	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	600519	贵州茅台	93,578,069.01	54.12
2	600036	招商银行	60,413,497.02	34.94
3	000333	美的集团	50,956,746.00	29.47
4	601318	中国平安	49,894,970.70	28.85
5	000651	格力电器	49,267,564.23	28.49
6	601166	兴业银行	41,623,743.51	24.07
7	600900	长江电力	38,405,381.68	22.21
8	300760	迈瑞医疗	35,737,600.15	20.67

9	000568	泸州老窖	29,094,605.15	16.83
10	601888	中国中免	23,113,529.13	13.37
11	300124	汇川技术	21,817,280.65	12.62
12	002142	宁波银行	20,277,957.70	11.73
13	600141	兴发集团	19,477,584.55	11.26
14	600050	中国联通	18,741,052.00	10.84
15	600690	海尔智家	18,329,735.01	10.60
16	600426	华鲁恒升	16,795,782.16	9.71
17	603288	海天味业	16,400,062.60	9.48
18	601601	中国太保	15,660,028.00	9.06
19	002027	分众传媒	14,715,956.19	8.51
20	601699	潞安环能	14,142,088.00	8.18
21	603369	今世缘	13,977,823.65	8.08
22	600030	中信证券	13,931,981.00	8.06
23	601390	中国中铁	13,686,166.00	7.91
24	601899	紫金矿业	13,424,092.00	7.76
25	601668	中国建筑	13,338,935.20	7.71
26	300316	晶盛机电	13,180,864.00	7.62
27	600809	山西汾酒	12,757,587.66	7.38
28	601618	中国中冶	12,601,283.00	7.29
29	002050	三花智控	12,600,759.52	7.29
30	000063	中兴通讯	12,385,841.54	7.16
31	002812	恩捷股份	12,239,317.80	7.08
32	600887	伊利股份	11,642,010.01	6.73
33	300012	华测检测	11,550,059.81	6.68
34	600741	华域汽车	11,427,679.00	6.61
35	600438	通威股份	11,367,004.00	6.57
36	600660	福耀玻璃	11,360,319.00	6.57
37	000776	广发证券	11,129,044.00	6.44
38	601669	中国电建	11,103,676.00	6.42
39	000807	云铝股份	11,051,183.00	6.39

40	603185	上机数控	10,910,534.26	6.31
41	601985	中国核电	10,888,827.00	6.30
42	002080	中材科技	10,820,839.00	6.26
43	002555	三七互娱	10,790,173.00	6.24
44	600803	新奥股份	10,748,450.00	6.22
45	600563	法拉电子	10,544,569.00	6.10
46	002714	牧原股份	10,463,215.55	6.05
47	601319	中国人保	10,386,862.79	6.01
48	600096	云天化	10,305,490.00	5.96
49	002244	滨江集团	9,977,426.00	5.77
50	601688	华泰证券	9,876,378.00	5.71
51	000858	五粮液	9,790,455.00	5.66
52	600383	金地集团	9,754,956.00	5.64
53	601881	中国银河	9,754,875.24	5.64
54	603605	珀莱雅	9,481,633.00	5.48
55	002416	爱施德	9,478,178.20	5.48
56	600048	保利发展	9,394,968.00	5.43
57	600153	建发股份	9,372,542.57	5.42
58	000002	万科 A	9,279,260.00	5.37
59	600968	海油发展	9,057,565.00	5.24
60	601211	国泰君安	9,032,138.00	5.22
61	002372	伟星新材	9,021,758.00	5.22
62	601186	中国铁建	8,959,779.00	5.18
63	000598	兴蓉环境	8,871,759.00	5.13
64	002736	国信证券	8,779,440.00	5.08
65	603882	金城医学	8,691,527.10	5.03
66	601009	南京银行	8,684,783.00	5.02
67	601919	中远海控	8,593,153.51	4.97
68	601728	中国电信	8,561,408.00	4.95
69	603444	吉比特	8,456,923.00	4.89
70	601168	西部矿业	8,378,565.00	4.85

71	002396	星网锐捷	8,337,946.71	4.82
72	600188	兖矿能源	8,319,570.00	4.81
73	600325	华发股份	8,311,412.19	4.81
74	600436	片仔癀	8,159,941.87	4.72
75	600901	江苏租赁	8,026,867.40	4.64
76	002049	紫光国微	7,945,018.00	4.59
77	300498	温氏股份	7,878,671.00	4.56
78	300122	智飞生物	7,868,918.00	4.55
79	603833	欧派家居	7,679,210.58	4.44
80	002415	海康威视	7,655,167.00	4.43
81	300628	亿联网络	7,446,282.44	4.31
82	601377	兴业证券	7,388,611.40	4.27
83	600985	淮北矿业	7,331,962.00	4.24
84	600704	物产中大	7,331,233.00	4.24
85	002493	荣盛石化	7,289,407.00	4.22
86	000733	振华科技	7,215,216.00	4.17
87	600507	方大特钢	7,167,887.79	4.15
88	002032	苏泊尔	6,985,564.00	4.04
89	601100	恒立液压	6,831,867.00	3.95
90	002410	广联达	6,694,054.00	3.87
91	002867	周大生	6,690,315.00	3.87
92	600582	天地科技	6,620,537.00	3.83
93	601766	中国中车	6,501,030.95	3.76
94	002408	齐翔腾达	6,400,974.60	3.70
95	000895	双汇发展	6,149,869.00	3.56
96	002271	东方雨虹	6,041,207.46	3.49
97	000933	神火股份	6,007,200.40	3.47
98	601717	郑煤机	5,998,948.00	3.47
99	300750	宁德时代	5,927,311.00	3.43
100	000785	居然之家	5,828,840.00	3.37
101	300699	光威复材	5,788,326.00	3.35

102	603757	大元泵业	5,660,786.00	3.27
103	600893	航发动力	5,533,455.00	3.20
104	600309	万华化学	5,395,501.00	3.12
105	600600	青岛啤酒	5,381,181.00	3.11
106	603712	七一二	5,328,279.00	3.08
107	688111	金山办公	5,300,214.56	3.07
108	000893	亚钾国际	5,247,569.00	3.03
109	600566	济川药业	5,179,567.00	3.00
110	601158	重庆水务	5,131,362.40	2.97
111	600419	天润乳业	5,111,934.00	2.96
112	600028	中国石化	5,088,744.00	2.94
113	603267	鸿远电子	4,996,437.00	2.89
114	300624	万兴科技	4,951,848.00	2.86
115	002179	中航光电	4,941,661.67	2.86
116	601336	新华保险	4,937,224.00	2.86
117	002959	小熊电器	4,935,403.85	2.85
118	002709	天赐材料	4,884,892.00	2.82
119	300433	蓝思科技	4,859,172.00	2.81
120	600584	长电科技	4,839,658.00	2.80
121	688569	铁科轨道	4,836,021.50	2.80
122	601225	陕西煤业	4,796,919.00	2.77
123	000921	海信家电	4,712,159.00	2.73
124	301239	普瑞眼科	4,653,108.00	2.69
125	300494	盛天网络	4,611,916.00	2.67
126	601633	长城汽车	4,584,106.00	2.65
127	600373	中文传媒	4,566,570.00	2.64
128	002536	飞龙股份	4,545,431.00	2.63
129	300896	爱美客	4,513,826.00	2.61
130	600346	恒力石化	4,470,403.00	2.59
131	000977	浪潮信息	4,409,321.00	2.55
132	002831	裕同科技	4,406,987.00	2.55

133	002478	常宝股份	4,387,141.00	2.54
134	300532	今天国际	4,329,321.00	2.50
135	688551	科威尔	4,296,282.40	2.48
136	688112	鼎阳科技	4,250,250.36	2.46
137	300866	安克创新	4,230,456.00	2.45
138	603215	比依股份	4,219,210.00	2.44
139	300378	鼎捷软件	4,207,259.00	2.43
140	600585	海螺水泥	4,206,250.00	2.43
141	000930	中粮科技	4,200,997.00	2.43
142	600233	圆通速递	4,178,501.00	2.42
143	603518	锦泓集团	4,114,613.00	2.38
144	301257	普蕊斯	4,095,003.00	2.37
145	603338	浙江鼎力	4,063,170.00	2.35
146	603345	安井食品	4,049,995.00	2.34
147	600933	爱柯迪	4,038,924.42	2.34
148	002690	美亚光电	4,037,127.70	2.33
149	600612	老凤祥	3,991,623.00	2.31
150	600211	西藏药业	3,980,950.00	2.30
151	002563	森马服饰	3,953,142.87	2.29
152	600845	宝信软件	3,908,867.00	2.26
153	600129	太极集团	3,894,477.00	2.25
154	600760	中航沈飞	3,871,654.19	2.24
155	601857	中国石油	3,774,230.00	2.18
156	002311	海大集团	3,768,115.60	2.18
157	603129	春风动力	3,740,507.00	2.16
158	300661	圣邦股份	3,720,044.00	2.15
159	600487	亨通光电	3,682,526.00	2.13
160	002120	韵达股份	3,572,885.00	2.07
161	002371	北方华创	3,557,415.00	2.06
162	001979	招商蛇口	3,554,104.00	2.06
163	601689	拓普集团	3,540,283.00	2.05

164	301101	明月镜片	3,531,663.00	2.04
165	600176	中国巨石	3,502,010.00	2.03
166	601333	广深铁路	3,497,905.00	2.02
167	600085	同仁堂	3,478,555.97	2.01

注：“买入金额”按买入成交金额（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	600519	贵州茅台	78,755,993.33	45.54
2	000333	美的集团	54,616,963.64	31.59
3	600900	长江电力	44,103,935.04	25.51
4	000651	格力电器	24,944,786.13	14.43
5	300760	迈瑞医疗	24,844,741.00	14.37
6	601166	兴业银行	23,039,644.95	13.32
7	600036	招商银行	22,070,220.07	12.76
8	600141	兴发集团	18,984,335.62	10.98
9	601668	中国建筑	17,492,436.80	10.12
10	300124	汇川技术	15,059,087.11	8.71
11	601699	潞安环能	14,653,228.59	8.47
12	600426	华鲁恒升	14,461,928.00	8.36
13	600030	中信证券	14,260,012.75	8.25
14	000858	五粮液	13,263,910.74	7.67
15	601899	紫金矿业	12,677,193.00	7.33
16	300012	华测检测	12,500,930.16	7.23
17	601318	中国平安	11,881,226.73	6.87
18	600563	法拉电子	11,476,561.80	6.64
19	603444	吉比特	11,321,002.00	6.55
20	600887	伊利股份	11,262,071.45	6.51
21	300316	晶盛机电	11,232,727.32	6.50

22	600803	新奥股份	11,085,730.00	6.41
23	000807	云铝股份	10,699,007.40	6.19
24	002027	分众传媒	10,690,535.00	6.18
25	603605	珀莱雅	10,676,173.20	6.17
26	600741	华域汽车	10,669,328.00	6.17
27	601186	中国铁建	10,519,631.00	6.08
28	600438	通威股份	10,369,480.36	6.00
29	002244	滨江集团	9,886,690.00	5.72
30	000598	兴蓉环境	9,665,265.29	5.59
31	000568	泸州老窖	9,570,574.00	5.53
32	601009	南京银行	9,556,376.32	5.53
33	002416	爱施德	9,045,906.71	5.23
34	600325	华发股份	8,799,700.31	5.09
35	300498	温氏股份	8,680,620.78	5.02
36	002372	伟星新材	8,550,583.98	4.94
37	002812	恩捷股份	8,464,061.11	4.89
38	603882	金域医学	8,414,786.00	4.87
39	002142	宁波银行	8,320,196.00	4.81
40	603288	海天味业	8,172,059.72	4.73
41	601888	中国中免	8,040,729.00	4.65
42	601319	中国人保	8,007,443.73	4.63
43	600507	方大特钢	7,882,734.84	4.56
44	002396	星网锐捷	7,756,654.00	4.49
45	601669	中国电建	7,533,878.00	4.36
46	002050	三花智控	7,363,594.00	4.26
47	600309	万华化学	7,284,798.00	4.21
48	002867	周大生	7,008,064.00	4.05
49	601377	兴业证券	6,945,410.80	4.02
50	600660	福耀玻璃	6,920,980.00	4.00
51	600582	天地科技	6,826,835.00	3.95
52	002032	苏泊尔	6,795,476.26	3.93

53	002493	荣盛石化	6,737,473.00	3.90
54	601919	中远海控	6,649,367.50	3.85
55	300628	亿联网络	6,634,032.80	3.84
56	002555	三七互娱	6,623,941.00	3.83
57	601881	中国银河	6,308,687.00	3.65
58	002080	中材科技	6,260,028.00	3.62
59	603757	大元泵业	6,231,542.00	3.60
60	603369	今世缘	6,197,689.04	3.58
61	000776	广发证券	6,179,542.00	3.57
62	000733	振华科技	6,058,078.00	3.50
63	600690	海尔智家	5,850,009.00	3.38
64	002415	海康威视	5,845,433.98	3.38
65	601100	恒立液压	5,829,836.00	3.37
66	600096	云天化	5,619,718.00	3.25
67	600050	中国联通	5,569,981.00	3.22
68	300699	光威复材	5,429,474.69	3.14
69	603185	上机数控	5,307,660.00	3.07
70	600985	淮北矿业	5,188,364.00	3.00
71	600419	天润乳业	5,151,113.21	2.98
72	002563	森马服饰	5,088,081.00	2.94
73	603712	七一二	5,070,822.00	2.93
74	000063	中兴通讯	5,036,924.00	2.91
75	002408	齐翔腾达	4,966,109.52	2.87
76	600346	恒力石化	4,910,555.00	2.84
77	601601	中国太保	4,896,045.60	2.83
78	600153	建发股份	4,892,355.00	2.83
79	600188	兖矿能源	4,868,760.00	2.82
80	600585	海螺水泥	4,863,411.00	2.81
81	300122	智飞生物	4,843,297.00	2.80
82	002690	美亚光电	4,842,433.00	2.80
83	601985	中国核电	4,828,567.00	2.79

84	601688	华泰证券	4,803,170.00	2.78
85	002179	中航光电	4,670,857.14	2.70
86	601618	中国中冶	4,567,502.00	2.64
87	601088	中国神华	4,533,085.00	2.62
88	600901	江苏租赁	4,502,414.17	2.60
89	601211	国泰君安	4,488,169.00	2.60
90	002831	裕同科技	4,449,976.60	2.57
91	603267	鸿远电子	4,392,337.00	2.54
92	000930	中粮科技	4,324,272.00	2.50
93	688111	金山办公	4,308,191.79	2.49
94	600436	片仔癀	4,306,567.95	2.49
95	002714	牧原股份	4,071,653.00	2.35
96	600968	海油发展	4,067,102.00	2.35
97	600941	中国移动	4,029,320.00	2.33
98	300820	英杰电气	3,983,872.25	2.30
99	300624	万兴科技	3,980,916.08	2.30
100	300378	鼎捷软件	3,968,764.00	2.30
101	002736	国信证券	3,966,624.00	2.29
102	300059	东方财富	3,941,158.53	2.28
103	000002	万科A	3,895,791.00	2.25
104	600048	保利发展	3,895,455.00	2.25
105	688617	惠泰医疗	3,870,631.32	2.24
106	002463	沪电股份	3,840,474.00	2.22
107	600487	亨通光电	3,825,325.03	2.21
108	000895	双汇发展	3,814,039.00	2.21
109	603338	浙江鼎力	3,764,976.97	2.18
110	600885	宏发股份	3,712,283.00	2.15
111	601006	大秦铁路	3,706,123.00	2.14
112	002602	世纪华通	3,639,082.00	2.10
113	300433	蓝思科技	3,637,791.74	2.10
114	600584	长电科技	3,631,051.00	2.10

115	601598	中国外运	3,565,938.00	2.06
116	603613	国联股份	3,559,494.00	2.06
117	600933	爱柯迪	3,557,266.90	2.06
118	601390	中国中铁	3,479,957.00	2.01

注：“卖出金额”按卖出成交金额（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	2,009,123,642.80
卖出股票收入（成交）总额	1,374,732,018.83

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的交易，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货交易时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

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

本基金暂不投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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
1	存出保证金	2,758,449.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	513,185.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,271,635.38

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
9,422	61,067.61	144,670,489.00	25.143 5%	430,708,507.58	74.856 5%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	431,849.97	0.0751%

8.3 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年12月21日)基金份额总额	119,111,800.66
本报告期期初基金份额总额	120,071,391.10
本报告期基金总申购份额	988,372,846.66
减：本报告期基金总赎回份额	533,065,241.18

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	575,378,996.58

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，本基金管理人于2023年6月1日聘任吴明建先生担任公司副总经理职务，吴明建先生现任公司副总经理、财务负责人职务。

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

10.6.1 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，未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期	佣金	占当期	

	单元数量		股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	30,785,703.12	0.91%	22,344.18	0.89%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	129,684,862.56	3.85%	94,257.58	3.77%	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	4	-	-	-	-	-
国金证券	4	-	-	-	-	-
财通证券	5	-	-	-	-	-
海通证券	6	3,211,955,754.83	95.24%	2,386,887.50	95.34%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全的证券经营机构；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1)投资、研究部门与券商联系商讨合作意向，根据公司对券商交易单元的选择标准，确定选用交易单元的所属券商以及（主）交易单元，报投资总监与总经理审核批准；
- (2)集中交易部与券商商议交易单元租用协议，经相关业务部门确认后，报公司领导审批；
- (3)基金清算部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理交易单元手续及账户开户手续。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	7,011,910.00	50.08%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

海通证券	6,989,49 5.00	49.9 2%	-	-	-	-	-	-
------	------------------	------------	---	---	---	---	---	---

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	财通基金管理有限公司关于设立成都分公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-01-18
2	财通沪深300指数增强型证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-21
3	财通基金管理有限公司分支机构负责人任职公告	中国证监会规定媒介	2023-02-04
4	关于财通沪深300指数增强型证券投资基金限制大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2023-02-21
5	财通沪深300指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2023年02月25日公告）	中国证监会规定媒介	2023-02-25
6	财通沪深300指数增强型证券投资基金托管协议（2023年02月25日公告）	中国证监会规定媒介	2023-02-25
7	财通基金管理有限公司关于财通沪深300指数增强型证券投资基金托管协议生效的公告	中国证监会规定媒介	2023-02-25
8	财通基金管理有限公司关于财通沪深300指数增强型证券投资基金证券交易模式转换有关事项的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-01
9	关于财通沪深300指数增强型证券投资基金恢复大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-07

10	财通基金管理有限公司关于财通沪深300指数增强型证券投资基金证券交易模式转换完成的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-11
11	关于上海爱建基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-22
12	财通沪深300指数增强型证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-30
13	财通基金管理有限公司关于设立浙江分公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-06
14	财通沪深300指数增强型证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-22
15	财通基金管理有限公司关于成都分公司经营范围变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-27
16	财通基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-05-05
17	关于江西正融基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2023-05-20
18	财通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-06-02
19	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2023-06-21
20	财通基金管理有限公司关于旗下基金更新招募说明书及基金产品资料概要的提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-06-30

21	财通沪深300指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2023年06月30日公告）	中国证监会规定媒介	2023-06-30
22	财通沪深300指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新（2023年06月30日公告）	中国证监会规定媒介	2023-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023-01-01至 2023-04-10	65,126,999.06	0.00	0.00	65,126,999.06	11.32%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金募集的文件；
- 2、财通沪深300指数增强型证券投资基金基金合同；
- 3、财通沪深300指数增强型证券投资基金托管协议；
- 4、财通沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书及其更新；
- 5、报告期内披露的各项公告；
- 6、法律法规要求备查的其他文件。

12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45楼。

12.3 查阅方式

投资者可在本基金管理人网站上免费查阅备查文件，对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：www.ctfund.com

财通基金管理有限公司
二〇二三年八月三十日