

长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2023 年 3 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。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 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	10
§ 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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	26
§ 8 投资组合报告	55

8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	56
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.....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
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.....	61
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.....	61
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.....	61
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
8.12 投资组合报告附注.....	62
§ 9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
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.....	63
§ 10 开放式基金份额变动	63
§ 11 重大事件揭示	64
11.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
11.4 基金投资策略的改变.....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
11.8 其他重大事件.....	67
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
§ 13 备查文件目录	71
13.1 备查文件目录.....	71
13.2 存放地点.....	71
13.3 查阅方式.....	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金	
基金简称	长信低碳环保量化股票	
基金主代码	004925	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 11 月 9 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	332,937,043.46 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信低碳环保量化股票 A	长信低碳环保量化股票 C
下属分级基金的交易代码	004925	013151
报告期末下属分级基金的份额总额	284,410,826.02 份	48,526,217.44 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，并精选低碳环保行业的优质企业进行投资，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。
业绩比较基准	中证环保产业指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

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		长信基金管理有限责任公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚	陆志俊
	联系电话	021-61009999	95559
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4007005566	95559
传真		021-61009800	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		刘元瑞	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、上海市仙霞路 18 号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	A 类份额：中国证券登记结算有限责任公司、C 类份额：长信基金管理有限责任公司	A 类份额：北京市西城区太平桥大街 17 号、C 类份额：上海市浦东新区银城中路 68 号 9 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	2022 年		2021 年	2021 年 8 月 12 日(基金合同生 效日)-2021 年 12 月 31 日	2020 年	
	长信低碳环保量 化股票 A	长信低碳环保量 化股票 C	长信低碳环保量 化股票 A	长信低碳环保量 化股票 C	长信低碳环保量 化股票 A	长信低 碳环保 量化股 票 C
本期已 实现收 益	-157,117,469.09	-18,045,777.53	104,118,284.25	1,748,391.80	46,175,378.90	-
本期利 润	-214,161,524.88	-33,660,767.76	62,112,568.23	-9,397,117.40	60,576,680.06	-
加权平 均基金 份额本 期利润	-0.6983	-0.8022	0.4071	-0.6406	0.9048	-
本期加 权平均 净值利 润率	-29.74%	-34.07%	15.23%	-22.33%	78.40%	-
本期基 金份额 净值增 长率	-27.57%	-27.87%	43.48%	-3.45%	102.35%	-

3.1.2 期末数 据和指 标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	189,214,865.88	45,688,830.44	381,549,921.65	73,086,309.10	33,131,289.00	—
期末可供分配基金份额利润	0.6653	0.9415	1.1684	1.6915	0.5730	—
期末基金资产净值	555,035,803.73	94,215,047.88	879,898,158.52	116,294,519.02	108,592,776.27	—
期末基金份额净值	1.9515	1.9415	2.6945	2.6915	1.8780	—
3.1.3 累计期 末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	95.15%	-29.66%	169.45%	-3.45%	87.80%	—

注：1、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。

2、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（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

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

长信低碳环保量化股票 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	-10.06%	1.96%	-5.34%	1.39%	-4.72%	0.57%
过去六个月	-29.02%	1.93%	-18.33%	1.39%	-10.69%	0.54%

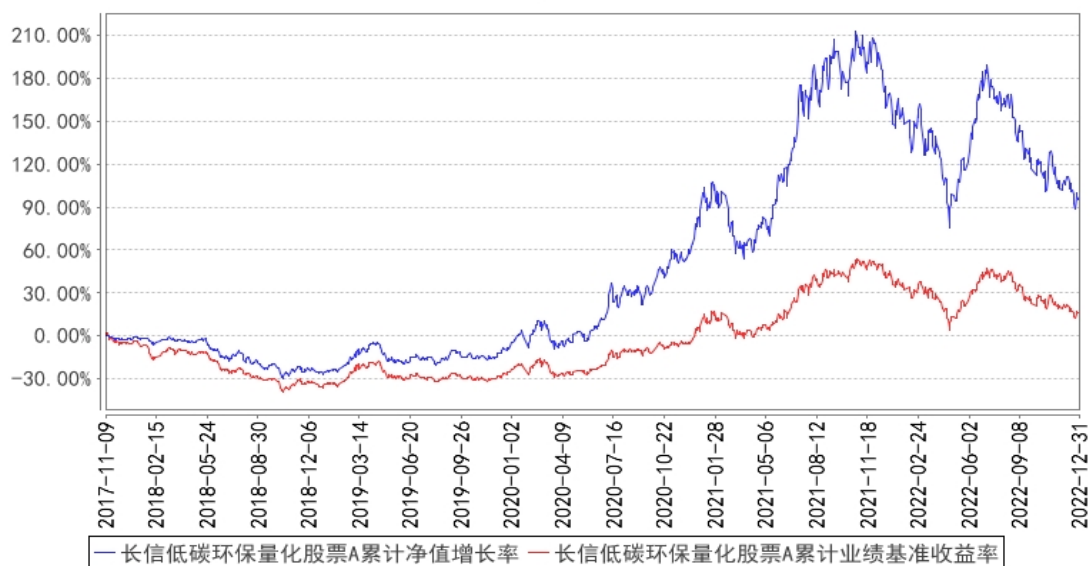
过去一年	-27.57%	2.25%	-19.96%	1.56%	-7.61%	0.69%
过去三年	110.27%	2.25%	54.50%	1.56%	55.77%	0.69%
过去五年	99.48%	1.91%	22.57%	1.42%	76.91%	0.49%
自基金合同生效 起至今	95.15%	1.88%	16.23%	1.40%	78.92%	0.48%

长信低碳环保量化股票 C

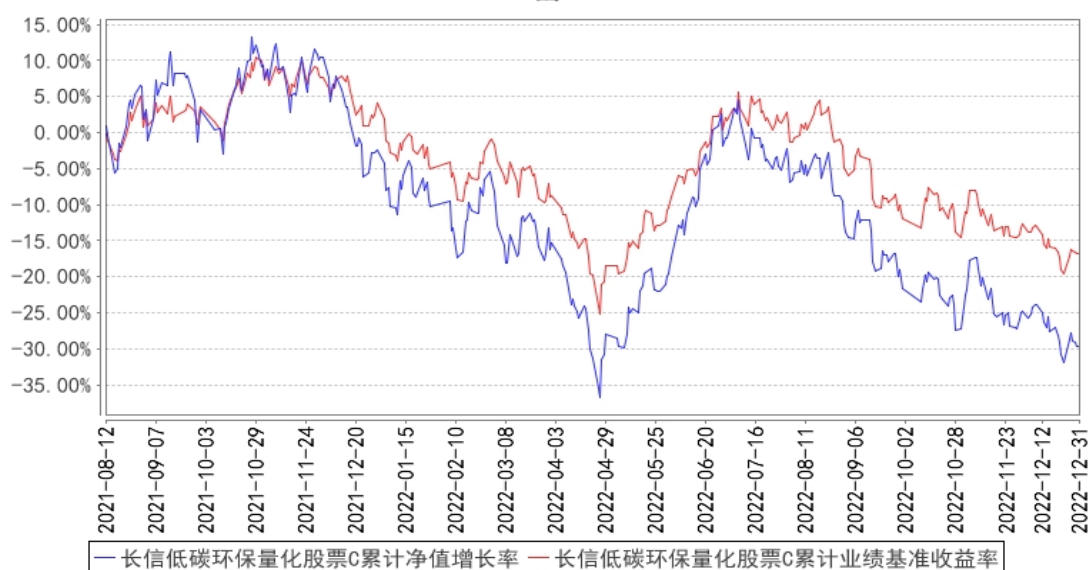
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-10.15%	1.96%	-5.34%	1.39%	-4.81%	0.57%
过去六个月	-29.16%	1.93%	-18.33%	1.39%	-10.83%	0.54%
过去一年	-27.87%	2.25%	-19.96%	1.56%	-7.91%	0.69%
自份额增加日起 至今	-29.66%	2.26%	-16.72%	1.52%	-12.94%	0.74%

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

长信低碳环保量化股票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



长信低碳环保量化股票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



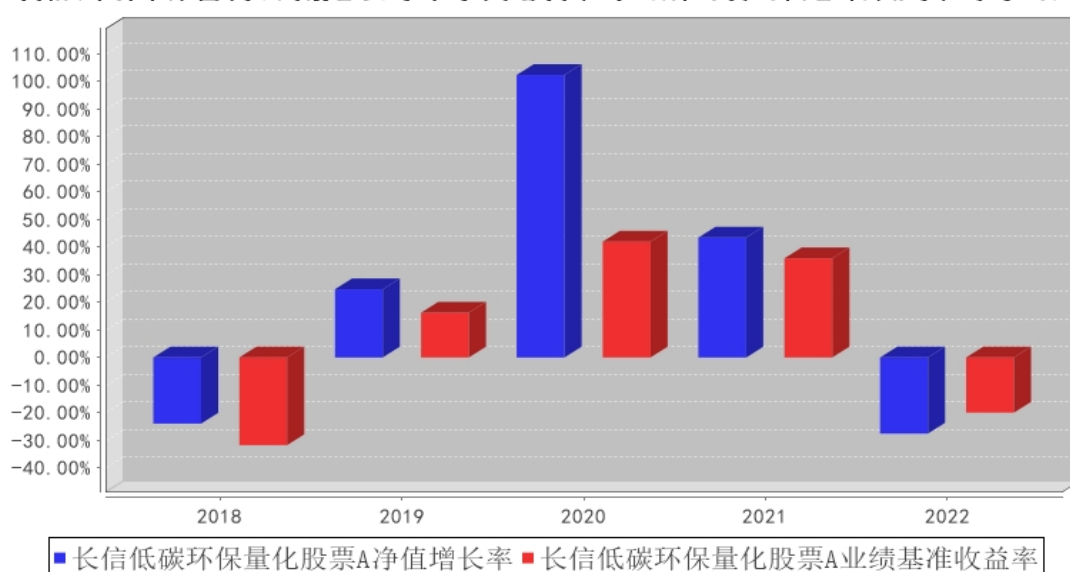
注：1、基金管理人自2021年8月12日起对长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为A类份额，增设C类份额。

2、长信低碳环保量化股票A图示日期为2017年11月9日至2022年12月31日，长信低碳环保量化股票C图示日期为2021年8月12日（份额增加日）至2022年12月31日。

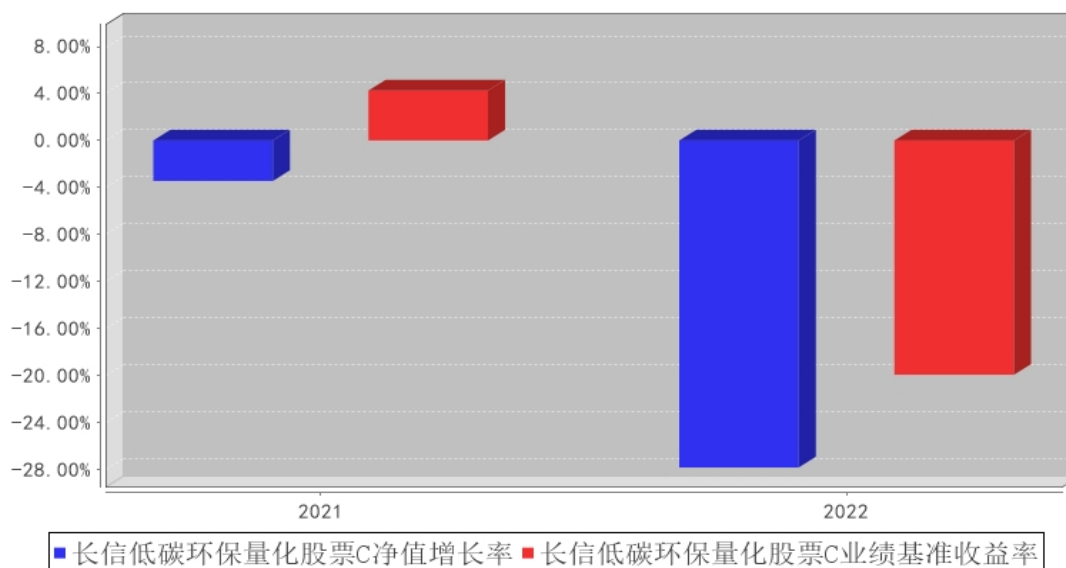
3、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

3.2.3 过去五年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

长信低碳环保量化股票A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长信低碳环保量化股票C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：长信低碳环保量化股票 C 图示份额计算期间为自份额增加日 2021 年 8 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日，2021 年净值增长率按长信低碳环保量化股票 C 份额实际存续期计算。

长信低碳环保量化股票 A 过去五年计算期间为 2018 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日。

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

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63 号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本 1.65 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 85 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长

信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）、长信价值优选混合型证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信颐年平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合

型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金。

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		
左金保	长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金和长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金的基金经理、总经理助理、量化投资部总监、投资决策委员会执行委员	2017 年 11 月 9 日	-	12 年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业，具有基金从业资格，中国国籍。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、量化研究部总监、长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金和长信量化价值驱动混合型证券投资基金的基金经理。现任总经理助理、量化投资部总监、投资决策委员会执行委员、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资

					资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金和长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金的基金经理。
姚 奕 帆	长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金和长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金的基金经理	2022 年 1 月 28 日	-	7 年	华威大学金融学硕士毕业，具有基金从业资格，中国国籍。2015 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，历任量化研究员、量化专户投资经理、基金经理助理，现任长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金和长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金的基金经理。

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

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

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

（1）严格按照时间顺序发送委托指令；

（2）对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统自动将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合且不同投资经理针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到 5:1 或以上的，根据市场情况审核后通过人工分发给不同交易员豁免公平交易。

。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，系统已强制开启公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与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% 的情形，未发现异常交易行为。同时，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

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

回顾 2022 年，全球新能源车市场延续了前一年的迅猛增长势头，产销量均大幅增长，主流车企规模效应显现，带动全产业链快速增长，除此之外，光伏、储能等碳中和相关领域迎来爆发式增长，业绩高增，然而受宏观经济、疫情反复、政策、成本等多因素的作用，新能源板块表现较为震荡。从行业景气度来看，目前新能源汽车销量快速增长的基础在于电动化、智能化带来的区别于传统燃油车的优质体验，上游成本、补贴退坡等因素不会影响长期景气度的向上趋势，放眼全球，渗透率在当前基础上仍有较大提升空间。今年受疫情反复和宏观经济低迷的压制，成长板

块有所回调，新能源汽车行业的估值水平调整至历史较低水平，为投资者提供了配置机会。自 2022 年末疫情政策持续优化，市场对经济复苏、消费提振的信心增强，结合主流企业规模效应带来的盈利能力提升，以及上游原材料的降价预期，新能源板块业绩持续增长的确信在增强。从风格上来看，联储加息进入尾声，业绩兑现预期高的成长板块有望持续占优，优质龙头企业得益于技术优势和一体化、全球化布局带来的成本优势，有望实现行业集中度的进一步提升。期内我们仍然坚持采用自下而上的数量化投资策略进行组合管理，着重考察投资标的业绩成长，估值匹配度等指标。此外在策略构建中也融合了绿色投资的投资理念，投资标的主要集中在环境保护相关的领域，板块包括但不限于公用事业、环保设备、废物处理、新能源设备、新能源汽车、园林绿化等板块，并且将在环境保护方面敷衍造假的上市公司纳入禁投清单，基金产品禁止投向清单内标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，长信低碳环保量化股票 A 基金份额净值为 1.9515 元，份额累计净值为 1.9515 元，本报告期内长信低碳环保量化股票 A 净值增长率为-27.57%；长信低碳环保量化股票 C 基金份额净值为 1.9415 元，份额累计净值为 1.9415 元，本报告期内长信低碳环保量化股票 C 净值增长率为-27.87%，同期业绩比较基准收益率为-19.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为新能源汽车行业将继续维持高景气度，长期增长趋势不变，同时在过去两年高速增长后，未来的行业整体增速中枢将会有所下移，进入稳健成长阶段。2022 年上游资源价格维持高位，随着产能的持续投放、供需格局的改善，原材料价格的下跌或能在 2023 年改善中游材料和电池端的利润水平，并将在一定程度上抵消补贴政策退坡带来的影响。除电动车和锂电领域外，硅料跌价、电力现货市场改革和共享储能电站商业模式的推出，将极大改善光伏和储能领域的经济性，2023 年国内大储装机量预计高增。在此过程中，我们认为需要对产能和下游配套情况、供应链成本优势以及技术进步方向保持敏感性，我们将重点关注具备供应链优势、技术优势、成本优势、具备高确定性、高成长性的各环节龙头公司以及行业内的新兴技术方向，包括 4680 电池、钠离子电池、电镀铜、钙钛矿等技术方向。我们会继续坚持绿色投资理念，建立绿色投资管理标准，在力争保持投资组合稳定回报的同时，增强在环境可持续方向上的投资能力。我们会继续严格执行系统化的量化投资策略，通过自下而上的策略寻找优质标的，不断调整、迭代模型，努力获取超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及配套法律法规，时刻以合规运作、

防范风险为核心，以维护基金持有人利益为宗旨，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部独立地开展工作，对基金运作进行事前、事中与事后的监督检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向公司董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本年度内，为确保监管要求的有效实施，公司监察稽核部根据各项法律法规监管政策性要求以及公司内部控制执行情况，积极开展公司业务流程及风险梳理的工作，适时组织召开内部控制委员会会议，对各项监管要求进行解读，并对各业务部门业务流程及制度规范的调整进行深入探讨，加强对关键业务岗位合规传导及培训工作。

本年度内，监察稽核部以组合压力测试为主要方式，定期对投资组合的风险状况进行检测，对投资组合整体流动性情况进行分析，并适时召集各业务部门的沟通会议就各项可能面临的风险进行沟通、讨论，防范组合风险事件发生。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则，秉持风控优先、内控从严的理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和实效性、并完善内部控制体系，做好各项内控工作，努力防范和控制各种风险，确保基金资产的规范运作，充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人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，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性及适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成，相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基

金本报告期没有进行利润分配。

4.9 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

无。

§ 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，基金托管人在长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，长信基金管理有限责任公司在长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金投资运作、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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由长信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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	德师报(审)字(23)第 P00816 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	长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。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中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况、2022 年度的

	经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	长信基金管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金 2022 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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而导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长信低碳环保行业量化股票型证券投资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，除非基金管理人管理层计划清算长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： (1) 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。 (2) 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。 (3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 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，就可能对长信低碳环保行业量化股票型证券投资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长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金不能持续经营。 (5) 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。 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。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	汪芳	冯适
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼	
审计报告日期	2023 年 3 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	45,348,740.26	112,536,101.84
结算备付金		435,846.54	2,122,363.06
存出保证金		239,123.87	248,331.15
交易性金融资产	7.4.7.2	605,395,575.41	913,864,463.87
其中：股票投资		605,395,575.41	913,864,463.87
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		78,468.51	-
应收股利		-	-
应收申购款		559,797.56	2,736,132.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	17,645.82
资产总计		652,057,552.15	1,031,525,038.29
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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		-	18,690,147.95
应付赎回款		989,711.70	14,141,672.81
应付管理人报酬		859,699.61	1,213,591.46
应付托管费		143,283.28	202,265.25
应付销售服务费		33,056.47	36,196.24
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	7.4.7.9	780,949.48	1,048,487.04
负债合计		2,806,700.54	35,332,360.75
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	332,937,043.46	369,757,898.28
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	316,313,808.15	626,434,779.26
净资产合计		649,250,851.61	996,192,677.54
负债和净资产总计		652,057,552.15	1,031,525,038.29

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，长信低碳环保量化股票 A 份额净值 1.9515 元，长信低碳环保量化股票 C 份额净值 1.9415 元。基金份额总额为 332,937,043.46 份，其中长信低碳环保量

化股票 A 份额 284,410,826.02 份，长信低碳环保量化股票 C 份额 48,526,217.44 份。

2、以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-232,910,928.72	63,275,881.81
1. 利息收入		466,880.13	304,427.49
其中：存款利息收入	7.4.7.13	466,880.13	304,425.59
债券利息收入		-	1.90
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）		-163,086,558.79	109,792,692.34
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-167,142,979.02	109,165,931.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	1,142,746.87	2,803.29
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	2,913,673.36	623,957.99
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损	7.4.7.20	-72,659,046.02	-53,151,225.22

失以“-”号填列)			
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列)	7.4.7.21	2,367,795.96	6,329,987.20
减：二、营业总支出		14,911,363.92	10,560,430.98
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	12,267,796.07	6,269,757.88
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,044,632.72	1,044,959.60
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	389,853.36	60,651.64
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2.55	-
8. 其他费用	7.4.7.23	209,079.22	3,185,061.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		-247,822,292.64	52,715,450.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		-247,822,292.64	52,715,450.83
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-247,822,292.64	52,715,450.83

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在2022年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金

本报告期：2022年1月1日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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(基金净值)	369,757,898.28	-	626,434,779.26	996,192,677.54
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末净资产(基金净值)	369,757,898.28	-	626,434,779.26	996,192,677.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-36,820,854.82	-	-310,120,971.11	-346,941,825.93
(一)、综合收益总额	-	-	-247,822,292.64	-247,822,292.64
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-36,820,854.82	-	-62,298,678.47	-99,119,533.29
其中: 1. 基金申购款	297,367,261.25	-	421,457,469.00	718,824,730.25
2. 基金赎回款	-334,188,116.07	-	-483,756,147.47	-817,944,263.54
(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)	332,937,043.46	-	316,313,808.15	649,250,851.61
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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(基金净值)	57,822,442.47	-	50,770,333.80	108,592,776.27
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	57,822,442.47	-	50,770,333.80	108,592,776.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	311,935,455.81	-	575,664,445.46	887,599,901.27
(一)、综合收益总额	-	-	52,715,450.83	52,715,450.83
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	311,935,455.81	-	522,948,994.63	834,884,450.44

（净值减少以“-”号填列）				
其中 1. 基金申购款	744,842,281.41	-	1,239,022,878.52	1,983,865,159.93
2. 基金赎回款	-432,906,825.60	-	-716,073,883.89	-1,148,980,709.49
（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、本期末净资产（基金净值）	369,757,898.28	-	626,434,779.26	996,192,677.54

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：

刘元瑞

覃波

孙红辉

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

长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《长信低碳环保行业量化股票型证

券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2017]1075 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 323,689,266.32 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(17)第 00488 号验资报告。基金合同于 2017 年 11 月 9 日生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据本基金管理人于 2021 年 8 月 10 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金增设 C 类基金份额相关事项的公告》,从 2021 年 8 月 12 日起,本基金增设 C 类份额(以下简称“长信低碳环保量化股票 C”),长信低碳环保量化股票 C 的年销售服务费率为 0.40%。本基金分类后,原有基金份额将自动划归为本基金 A 类基金份额(以下简称“长信低碳环保量化股票 A”),长信低碳环保量化股票 A 不收取销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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、地方政府债、中小企业私募债券、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)、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货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)。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:股票资产占基金资产的比例为 80%-95%;投资于低碳环保行业的证券资产不低于非现金基金资产的 80%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。本基金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,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:中证环保产业指数收益率 $\times$ 80%+中债综合指数收益率 $\times$ 20%。

7.4.2 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,在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分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。

金融资产的合同条款规定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，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售

的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为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。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，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) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按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变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失

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信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提。

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 0.40% 的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产款支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告；

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3) 基金收益分配后各类基金份额的份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) 同一类别每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

7.4.4.13 分部报告

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) 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)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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 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，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《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》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 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，根据《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》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24 号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制 2022 年度财务报表时已采用该准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收申购款，金额分别为人民币 112,536,101.84 元、人民币 2,122,363.06 元、人民币 248,331.15 元、人民币 17,645.82 元、人民币 2,736,132.55 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证金、应收申购款、其他资产-应收利息的金额分别为人民币 112,551,480.45 元、人民币 2,123,318.16 元、人民币 248,442.95 元、人民币 2,737,332.86 元、人民币 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 913,864,463.87 元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 0.00 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 913,864,463.87 元。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、

债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(2) 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，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	45,348,740.26	112,536,101.84
等于：本金	45,340,029.03	112,536,101.84
加：应计利息	8,711.23	-
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	45,348,740.26	112,536,101.84

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		703,064,318.10	-	605,395,575.41	-97,668,742.69
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		703,064,318.10	-	605,395,575.41	-97,668,742.69
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		938,874,160.54	-	913,864,463.87	-25,009,696.67
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		938,874,160.54	-	913,864,463.87	-25,009,696.67

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未持有衍生金融工具。

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未持有买入返售金融资产。

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未持有因买断式逆回购交易而取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末无债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	17,645.82
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	17,645.82

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,416.38	30,181.72
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	589,533.10	868,305.32
其中：交易所市场	589,533.10	868,305.32
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	70,000.00	70,000.00
预提信息披露费	120,000.00	80,000.00
合计	780,949.48	1,048,487.04

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长信低碳环保量化股票 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	326,549,688.36	326,549,688.36
本期申购	237,529,434.18	237,529,434.18
本期赎回（以“-”号填列）	-279,668,296.52	-279,668,296.52
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	284,410,826.02	284,410,826.02

长信低碳环保量化股票 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	43,208,209.92	43,208,209.92
本期申购	59,837,827.07	59,837,827.07
本期赎回（以“-”号填列）	-54,519,819.55	-54,519,819.55
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	48,526,217.44	48,526,217.44

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

7.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末及上年度末无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长信低碳环保量化股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	381,549,921.65	171,798,548.51	553,348,470.16
本期利润	-157,117,469.09	-57,044,055.79	-214,161,524.88
本期基金份额交易产生的变动数	-35,217,586.68	-33,344,380.89	-68,561,967.57
其中：基金申购款	210,073,446.36	125,177,826.76	335,251,273.12
基金赎回款	-245,291,033.04	-158,522,207.65	-403,813,240.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	189,214,865.88	81,410,111.83	270,624,977.71

长信低碳环保量化股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	90,149,481.63	-17,063,172.53	73,086,309.10
本期利润	-18,045,777.53	-15,614,990.23	-33,660,767.76
本期基金份额交易产生的变动数	4,336,929.53	1,926,359.57	6,263,289.10
其中：基金申购款	103,525,704.29	-17,319,508.41	86,206,195.88
基金赎回款	-99,188,774.76	19,245,867.98	-79,942,906.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	76,440,633.63	-30,751,803.19	45,688,830.44

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	433,709.10	277,950.86
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	27,518.09	18,197.91
其他	5,652.94	8,276.82
合计	466,880.13	304,425.59

注：其他为申购款利息收入和保证金利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,237,698,259.86	1,078,647,665.25
减：卖出股票成本总额	2,399,211,746.46	969,481,734.19
减：交易费用	5,629,492.42	-
买卖股票差价收入	-167,142,979.02	109,165,931.06

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	699.93	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,142,046.94	2,803.29
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	1,142,746.87	2,803.29

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,276,774.10	16,807.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,134,000.00	14,000.00
减：应计利息总额	721.07	3.71
减：交易费用	6.09	—
买卖债券差价收入	1,142,046.94	2,803.29

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益**7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17 贵金属投资收益**7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.18 衍生工具收益**7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期末及上年度末无衍生工具收益。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无其他衍生工具投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	2,913,673.36	623,957.99
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	2,913,673.36	623,957.99

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-72,659,046.02	-53,151,225.22
股票投资	-72,659,046.02	-53,147,420.02
债券投资	-	-3,805.20
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
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	-72,659,046.02	-53,151,225.22

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,360,755.07	6,273,002.42
基金转换费收入	7,040.89	56,984.78
合计	2,367,795.96	6,329,987.20

注：对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。对于持有期大于 7 日少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，其 75% 计入基金财产；对于持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 50% 计入基金财产；对于持有期长于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 25% 计入基金财产。

7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31
----	---------------------------------	---

	月 31 日	日
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
其他费用	19,079.22	24,228.81
交易费用	-	3,010,833.05
合计	209,079.22	3,185,061.86

注：其他费用为银行手续费等。

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生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
长信基金管理有限责任公司（以下简称“长信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海海欣集团股份有限公司（以下简称“海欣集团”）	基金管理人的股东
武汉钢铁有限公司（以下简称“武钢有限”）	基金管理人的股东
上海彤胜投资管理中心（有限合伙）（以下简称“彤胜投资”）	基金管理人的股东
上海彤骏投资管理中心（有限合伙）（以下简称“彤骏投资”）	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司（以下简称“长江财富”）	基金管理人的子公司
长江期货股份有限公司（以下简称“长江期货”）	基金管理人的股东的子公司

注：以下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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 (%)

长江证券	1,576,530,920.03	36.03	227,269,252.89	7.84
------	------------------	-------	----------------	------

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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 (%)
长江证券	6,276,774.10	100.00	-	-

7.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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 (%)
长江证券	1,468,224.97	49.68	300,961.10	51.05
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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 (%)
长江证券	211,654.18	12.98	184,855.59	21.29

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用长江证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从长江证券获得证券研究综合服务。

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 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,267,796.07	6,269,757.88
其中：支付销售机构的客户维护费	4,516,497.88	2,555,220.78

注：支付基金管理人长信基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 $\times 1.50\%$ 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值 $\times 1.50\% \div$ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,044,632.72	1,044,959.60

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 $\times 0.25\%$ 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 $\times 0.25\% \div$ 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 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		
	长信低碳环保量化股票 A	长信低碳环保量化股票 C	合计
长信基金	—	297,491.80	297,491.80
长江证券	—	1.82	1.82
合计	—	297,493.62	297,493.62
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信低碳环保量化股票 A	长信低碳环保量化股票 C	合计
长信基金	—	58,979.90	58,979.90
合计	—	58,979.90	58,979.90

注：本基金自 2021 年 8 月 13 日起实行销售服务费分级收费方式：长信低碳环保量化股票 A 不收取销售服务费，长信低碳环保量化股票 C 的销售服务费按基金前一日资产净值 $\times 0.40\%$ 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：长信低碳环保量化股票 C 的日销售服务费=前一日长信低碳环保量化股票 C 资产净值 $\times 0.40\% \div$ 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

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
	长信低碳环保量化股票 A	长信低碳环保量化股票 C
基金合同生效日（2017 年 11 月 9 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	—	—
报告期间申购/买入总份额	148,231.95	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	148,231.95	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.04%	—
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 8 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
	长信低碳环保量化股票 A	长信低碳环保量化股票 C
基金合同生效日（2017 年 11 月 9 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	—	—
报告期间申购/买入总份额	—	—

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书中公布的费率执行。

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

除基金管理人之外的其他关联方在本年末及上年度末均未持有本基金。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
交通银行	45,348,740.26	433,709.10	112,536,101.84	277,950.86

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的基金托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2022 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2021 年 12 月 31 日：同）。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022 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
301095	广立微	2022 年 7 月 28 日	6 个月	新股锁定	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301115	建科	2022	6 个月	新股锁	42.05	24.04	685	28,804.25	16,467.40	-

	股份	年 8 月 23 日		定						
301121	紫建 电子	2022 年 8 月 1 日	6 个月	新股锁 定	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301132	满坤 科技	2022 年 8 月 3 日	6 个月	新股锁 定	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301139	元道 通信	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁 定	38.46	25.31	566	21,768.36	14,325.46	-
301152	天力 锂能	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股锁 定	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-
301161	唯万 密封	2022 年 9 月 6 日	6 个月	新股锁 定	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301165	锐捷 网络	2022 年 11 月 14 日	6 个月	新股锁 定	32.38	31.61	763	24,705.94	24,118.43	-
301171	易点 天下	2022 年 8 月 10 日	6 个月	新股锁 定	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301175	中科 环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁 定	3.82	6.01	6,370	24,333.40	38,283.70	-
301195	北路 智控	2022 年 7 月 25 日	6 个月	新股锁 定	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
301197	工大 科雅	2022 年 7 月 29 日	6 个月	新股锁 定	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301227	森鹰 窗业	2022 年 9 月 16 日	6 个月	新股锁 定	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301239	普瑞 眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股锁 定	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-
301265	华新 环保	2022 年 12 月 8 日	6 个月	新股锁 定	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301269	华大 九天	2022 年 7 月	6 个月	新股锁 定	32.69	87.94	793	25,923.17	69,736.42	-

		21 日								
301270	汉仪股份	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股锁定	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301273	瑞晨环保	2022 年 10 月 11 日	6 个月	新股锁定	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301280	珠城科技	2022 年 12 月 19 日	6 个月	新股锁定	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301285	鸿日达	2022 年 9 月 21 日	6 个月	新股锁定	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301300	远翔新材	2022 年 8 月 9 日	6 个月	新股锁定	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301308	江波龙	2022 年 7 月 27 日	6 个月	新股锁定	55.67	56.72	819	45,593.73	46,453.68	-
301313	凡拓数创	2022 年 9 月 22 日	6 个月	新股锁定	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301318	维海德	2022 年 8 月 3 日	6 个月	新股锁定	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-
301319	唯特偶	2022 年 9 月 22 日	6 个月	新股锁定	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301328	维峰电子	2022 年 8 月 30 日	6 个月	新股锁定	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301330	熵基科技	2022 年 8 月 10 日	6 个月	新股锁定	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14	-
301338	凯格精机	2022 年 8 月 8 日	6 个月	新股锁定	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301339	通行宝	2022 年 9 月 2 日	6 个月	新股锁定	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67	-
301356	天振股份	2022 年 11 月	6 个月	新股锁定	63.00	43.33	448	28,224.00	19,411.84	-

		月 3 日								
301361	众智科技	2022 年 11 月 8 日	6 个月	新股锁定	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32	-
301366	一博科技	2022 年 9 月 19 日	6 个月	新股锁定	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-
301388	欣灵电气	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股锁定	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301396	宏景科技	2022 年 11 月 4 日	6 个月	新股锁定	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40	-
688252	天德钰	2022 年 9 月 20 日	6 个月	新股锁定	21.68	15.78	5,201	112,757.68	82,071.78	-
688273	麦澜德	2022 年 8 月 4 日	6 个月	新股锁定	40.29	31.52	3,568	143,754.72	112,463.36	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	6 个月	新股锁定	21.93	25.28	12,704	278,598.72	321,157.12	-
688426	康为世纪	2022 年 10 月 18 日	6 个月	新股锁定	48.98	33.12	3,776	184,948.48	125,061.12	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无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

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

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因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

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、流动性风险和市场风险。本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，战略与产品研发部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 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。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

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。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制。

本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人流动性指标进行持续的监测和分析，定期开展压力测试，评估在不同的压力情境下资产变现情况的变化。

基金管理人持续监测本基金开放期内的赎回情况，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整投资组合资产结构及比例，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

同时，针对兑付赎回资金的流动性风险，基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。

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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	45,348,740.26	-	-	-	-	45,348,740.26
结算备付金	435,846.54	-	-	-	-	435,846.54
存出保证金	239,123.87	-	-	-	-	239,123.87
交易性金融资产	-	-	-	-	605,395,575.41	605,395,575.41
应收申购款	-	-	-	-	559,797.56	559,797.56
应收清算款	-	-	-	-	78,468.51	78,468.51
资产总计	46,023,710.67	-	-	-	606,033,841.48	652,057,552.15
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	989,711.70	989,711.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	859,699.61	859,699.61
应付托管费	-	-	-	-	143,283.28	143,283.28
应付销售服务费	-	-	-	-	33,056.47	33,056.47
其他负债	-	-	-	-	780,949.48	780,949.48
负债总计	-	-	-	-	2,806,700.54	2,806,700.54
利率敏感度缺口	46,023,710.67	-	-	-	603,227,140.94	649,250,851.61
上年度末 2021 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	112,536,101.84	-	-	-	-	112,536,101.84
结算备付金	2,122,363.06	-	-	-	-	2,122,363.06
存出保证金	248,331.15	-	-	-	-	248,331.15
交易性金融资产	-	-	-	-	913,864,463.87	913,864,463.87
应收申购款	447.32	-	-	-	2,735,685.23	2,736,132.55
其他资产	-	-	-	-	17,645.82	17,645.82
资产总计	114,907,243.37	-	-	-	916,617,794.92	1,031,525,038.29
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	18,690,147.95	18,690,147.95
应付赎回款	-	-	-	-	14,141,672.81	14,141,672.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,213,591.46	1,213,591.46
应付托管费	-	-	-	-	202,265.25	202,265.25
应付销售服务费	-	-	-	-	36,196.24	36,196.24
其他负债	-	-	-	-	1,048,487.04	1,048,487.04
负债总计	-	-	-	-	35,332,360.75	35,332,360.75
利率敏感度缺口	114,907,243.37	-	-	-	881,285,434.17	996,192,677.54

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末及上年度末均未持有债券，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

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的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）等指标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。

于 12 月 31 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	605,395,575.41	93.25	913,864,463.87	91.74
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	605,395,575.41	93.25	913,864,463.87	91.74

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险
----	---------------------------

	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（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	VaR 值为 5.55%(2021 年 12 月 31 日 VaR 值为 6.64%)	-36,013,138.69	-66,182,233.00

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2021 年的分析同样基于该假设。

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	604,132,177.79	910,180,412.52
第二层次	-	891,557.33
第三层次	1,263,397.62	2,792,494.02
合计	605,395,575.41	913,864,463.87

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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，本基金分别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根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

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

项目	本期 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	股票投资	
期初余额	-	2,792,494.02	2,792,494.02
当期购买	-	1,320,315.19	1,320,315.19
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,621,469.52	2,621,469.52
当期利得或损失总额	-	-227,942.07	-227,942.07
其中：计入损益的利得或损失	-	-227,942.07	-227,942.07
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,263,397.62	1,263,397.62
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	-	-56,917.57	-56,917.57
项目	上年度可比同期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	26,728.60	26,728.60
当期购买	-	2,495,563.95	2,495,563.95
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	36,584.59	36,584.59
当期利得或损失总额	-	306,786.06	306,786.06
其中：计入损益的利得或损失	-	306,786.06	306,786.06
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,792,494.02	2,792,494.02
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	-	296,930.07	296,930.07

——公允价值变动损益			
------------	--	--	--

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
股票投资	1,263,397.62	平均价格 亚式期权 模型	股票在剩余限售期内的估价的预期年化波动率	18.91%-97.55%	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
股票投资	2,792,494.02	平均价格 亚式期权 模型	股票在剩余限售期内的估价的预期年化波动率	17.17% -274.17%	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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	605,395,575.41	92.84
	其中：股票	605,395,575.41	92.84
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	45,784,586.80	7.02
8	其他各项资产	877,389.94	0.13
9	合计	652,057,552.15	100.00

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

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	-	-
B	采矿业	9,989,520.20	1.54
C	制造业	587,852,217.66	90.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,125,296.00	1.10
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,379.04	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	319,345.41	0.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	16,467.40	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	38,283.70	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	40,066.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	605,395,575.41	93.25

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

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	300750	宁德时代	131,100	51,577,362.00	7.94
2	002466	天齐锂业	526,300	41,572,437.00	6.40
3	002594	比亚迪	122,798	31,555,402.06	4.86
4	300124	汇川技术	346,500	24,081,750.00	3.71
5	300073	当升科技	421,900	23,795,160.00	3.67
6	002812	恩捷股份	178,950	23,494,345.50	3.62
7	300035	中科电气	1,015,300	20,894,874.00	3.22
8	300769	德方纳米	90,200	20,709,018.00	3.19
9	300438	鹏辉能源	250,000	19,497,500.00	3.00
10	688518	联赢激光	649,400	18,968,974.00	2.92
11	300693	盛弘股份	332,303	18,037,406.84	2.78
12	688599	天合光能	282,700	18,024,952.00	2.78
13	002865	钧达股份	96,400	17,843,640.00	2.75
14	688063	派能科技	55,000	17,360,750.00	2.67
15	002709	天赐材料	394,768	17,314,524.48	2.67
16	600732	爱旭股份	442,900	16,750,478.00	2.58
17	600481	双良节能	1,284,500	16,621,430.00	2.56
18	688556	高测股份	220,700	16,556,914.00	2.55
19	603612	索通发展	598,400	15,570,368.00	2.40
20	600438	通威股份	403,400	15,563,172.00	2.40
21	603876	鼎胜新材	376,500	15,451,560.00	2.38
22	688559	海目星	248,400	14,367,456.00	2.21
23	300014	亿纬锂能	158,558	13,937,248.20	2.15
24	300217	东方电热	2,078,600	11,785,662.00	1.82
25	002756	永兴材料	125,600	11,576,552.00	1.78
26	002459	晶澳科技	172,840	10,385,955.60	1.60
27	002192	融捷股份	102,038	9,989,520.20	1.54
28	002460	赣锋锂业	116,232	8,079,286.32	1.24
29	688707	振华新材	171,000	7,686,450.00	1.18
30	002850	科达利	61,300	7,283,053.00	1.12
31	000155	川能动力	399,400	7,125,296.00	1.10
32	300057	万顺新材	769,500	6,817,770.00	1.05
33	002738	中矿资源	99,000	6,599,340.00	1.02
34	002518	科士达	112,500	6,480,000.00	1.00
35	603799	华友钴业	103,460	5,755,479.80	0.89
36	688116	天奈科技	74,104	5,716,382.56	0.88
37	688349	三一重能	195,000	5,711,550.00	0.88
38	002129	TCL 中环	70,000	2,636,200.00	0.41
39	300680	隆盛科技	16,200	401,112.00	0.06
40	688475	萤石网络	13,341	345,932.13	0.05
41	688400	凌云光	12,704	321,157.12	0.05
42	301280	珠城科技	2,783	132,065.20	0.02

43	688426	康为世纪	3,776	125,061.12	0.02
44	688273	麦澜德	3,568	112,463.36	0.02
45	688252	天德钰	5,201	82,071.78	0.01
46	688525	佰维存储	4,614	74,100.84	0.01
47	301269	华大九天	793	69,736.42	0.01
48	301095	广立微	740	64,002.60	0.01
49	301308	江波龙	819	46,453.68	0.01
50	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.01
51	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.01
52	301165	锐捷网络	763	24,118.43	0.00
53	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
54	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
55	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
56	301356	天振股份	448	19,411.84	0.00
57	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
58	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
59	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
60	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
61	001298	好上好	403	14,379.04	0.00
62	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
63	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
64	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
65	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
66	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
67	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
68	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
69	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
70	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
71	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
72	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
73	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
74	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
75	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
76	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
77	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
78	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
79	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
80	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
81	000625	长安汽车	90	1,107.90	0.00
82	300587	天铁股份	66	760.32	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	002459	晶澳科技	112,034,407.49	11.25
2	603659	璞泰来	88,109,901.20	8.84
3	300568	星源材质	76,770,943.36	7.71
4	603799	华友钴业	67,013,045.85	6.73
5	300073	当升科技	66,633,885.46	6.69
6	002812	恩捷股份	55,478,328.34	5.57
7	300763	锦浪科技	53,506,198.82	5.37
8	300274	阳光电源	53,188,370.71	5.34
9	688516	奥特维	53,187,400.49	5.34
10	300035	中科电气	52,685,418.83	5.29
11	603806	福斯特	51,333,748.80	5.15
12	300919	中伟股份	47,988,799.00	4.82
13	002466	天齐锂业	46,919,964.16	4.71
14	601012	隆基绿能	46,114,512.43	4.63
15	002738	中矿资源	45,622,800.39	4.58
16	688599	天合光能	44,637,718.99	4.48
17	002192	融捷股份	44,395,953.60	4.46
18	300014	亿纬锂能	44,386,244.60	4.46
19	300861	美畅股份	38,401,258.72	3.85
20	300769	德方纳米	35,959,279.90	3.61
21	002594	比亚迪	34,956,746.55	3.51
22	603876	鼎胜新材	32,513,914.13	3.26
23	600885	宏发股份	31,807,034.00	3.19
24	000762	西藏矿业	30,772,074.00	3.09
25	688390	固德威	30,645,893.50	3.08
26	300390	天华超净	30,090,771.00	3.02
27	601615	明阳智能	29,812,332.78	2.99
28	688005	容百科技	29,053,218.94	2.92
29	688556	高测股份	28,841,376.84	2.90
30	300316	晶盛机电	28,819,325.60	2.89
31	002407	多氟多	28,206,868.00	2.83
32	600438	通威股份	26,779,568.64	2.69
33	603185	上机数控	26,731,872.40	2.68
34	605117	德业股份	26,661,126.41	2.68
35	688063	派能科技	26,425,982.30	2.65
36	000155	川能动力	25,903,251.82	2.60
37	600481	双良节能	25,167,279.00	2.53
38	300750	宁德时代	23,864,112.00	2.40
39	600732	爱旭股份	23,624,223.22	2.37
40	688518	联赢激光	23,480,463.25	2.36
41	603612	索通发展	23,468,230.00	2.36
42	000625	长安汽车	23,164,500.20	2.33

43	002756	永兴材料	23,162,252.00	2.33
44	002709	天赐材料	22,140,531.20	2.22
45	002240	盛新锂能	21,625,573.00	2.17
46	002920	德赛西威	21,280,235.95	2.14

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002459	晶澳科技	96,140,242.00	9.65
2	002812	恩捷股份	79,220,936.00	7.95
3	603799	华友钴业	78,957,043.57	7.93
4	300073	当升科技	74,224,200.12	7.45
5	300568	星源材质	73,660,387.99	7.39
6	603659	璞泰来	72,051,880.20	7.23
7	688516	奥特维	68,939,792.58	6.92
8	300035	中科电气	65,724,203.60	6.60
9	300763	锦浪科技	63,583,940.66	6.38
10	300769	德方纳米	62,203,426.84	6.24
11	002594	比亚迪	59,970,323.15	6.02
12	300316	晶盛机电	59,800,786.12	6.00
13	300014	亿纬锂能	54,640,523.32	5.48
14	002407	多氟多	53,365,689.51	5.36
15	002460	赣锋锂业	48,630,948.30	4.88
16	002709	天赐材料	47,319,317.60	4.75
17	603806	福斯特	46,053,966.81	4.62
18	300274	阳光电源	44,576,160.18	4.47
19	002850	科达利	44,240,185.00	4.44
20	300919	中伟股份	43,200,079.20	4.34
21	300037	新宙邦	42,234,376.37	4.24
22	002738	中矿资源	41,893,457.44	4.21
23	688005	容百科技	41,363,082.33	4.15
24	600885	宏发股份	40,027,673.60	4.02
25	002466	天齐锂业	39,663,643.00	3.98
26	300390	天华超净	38,752,709.00	3.89
27	601615	明阳智能	38,670,644.58	3.88
28	601012	隆基绿能	37,617,816.58	3.78
29	000625	长安汽车	34,258,022.70	3.44
30	600884	杉杉股份	34,227,796.48	3.44
31	300861	美畅股份	31,846,067.03	3.20
32	688388	嘉元科技	31,796,361.12	3.19
33	605117	德业股份	30,998,935.20	3.11
34	002192	融捷股份	30,526,063.00	3.06

35	688599	天合光能	28,150,733.01	2.83
36	000988	华工科技	26,744,276.60	2.68
37	000762	西藏矿业	24,364,838.00	2.45
38	603185	上机数控	23,867,993.78	2.40
39	002920	德赛西威	20,251,556.00	2.03
40	002240	盛新锂能	20,158,768.31	2.02

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

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	2,163,401,904.02
卖出股票收入（成交）总额	2,237,698,259.86

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（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。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

8.12.2 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

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

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
1	存出保证金	239,123.87
2	应收清算款	78,468.51
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	559,797.56
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	877,389.94

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处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 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（%）
长信低碳环保量化	53,682	5,298.07	19,872,145.89	6.99	264,538,680.13	93.01

股票 A						
长信低碳环保量化股票 C	1,249	38,852.06	41,635,970.41	85.80	6,890,247.03	14.20
合计	54,931	6,061.00	61,508,116.30	18.47	271,428,927.16	81.53

注：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）。

9.2 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	长信低碳环保量化股票 A	255,351.99	0.09
	长信低碳环保量化股票 C	359.15	0.00
	合计	255,711.14	0.08

注：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	长信低碳环保量化股票 A	0~10
	长信低碳环保量化股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长信低碳环保量化股票 A	10~50
	长信低碳环保量化股票 C	0
	合计	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信低碳环保量化股票 A	长信低碳环保量化股票 C
基金合同生效日（2017 年 11 月 9 日）基金份额总额	323,689,266.32	—
本报告期期初基金份额总额	326,549,688.36	43,208,209.92
本报告期基金总申购份额	237,529,434.18	59,837,827.07
减：本报告期基金总赎回份额	279,668,296.52	54,519,819.55
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	284,410,826.02	48,526,217.44

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开本基金的基金份额持有人大会。

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

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

自 2022 年 2 月 21 日起，安昀先生不再担任公司副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在规定信息披露媒介发布相关公告。

11.2.2 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，徐铁任交通银行资产托管部总经理

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所；报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币 70,000.00 元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为 5 年。

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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及督察长
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 1 月 18 日
采取稽查或处罚等措施的机构	上海证监局
受到的具体措施类型	责令改正及警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	内部控制制度未能得到有效执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改并验收通过
其他	无

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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 (%)	
中泰证券	1	1,580,263,175.84	36.12	839,594.28	28.41	-
长江证券	2	1,576,530,920.03	36.03	1,468,224.97	49.68	-
国泰君安	1	823,154,842.31	18.81	437,342.83	14.80	-
天风证券	1	395,565,307.05	9.04	210,165.11	7.11	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用东吴证券交易单元 1 个、浙商证券交易单元 1 个、民生证券交易单元 1 个。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29 号）和《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，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

(1) 选择标准:

- a、券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- b、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- c、券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- d、券商协作表现评价。

(2) 选择程序:

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

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(%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	6,276,774.10	100.00	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

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	长信基金管理有限责任公司关于增加济安财富（北京）基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 1 月 13 日
2	长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 1 月 24 日
3	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2021 年第四季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 1 月 24 日
4	长信基金管理有限责任公司关于增加四川天府银行股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 1 月 26 日
5	长信基金管理有限责任公司关于增聘长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金基金经理的公告	证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 1 月 29 日

6	长信基金管理有限责任公司关于增加第一创业证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 8 日
7	长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 9 日
8	长信基金管理有限责任公司关于增加旗下部分开放式基金参加“长金通”网上直销平台及直销柜台基金转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 16 日
9	长信基金管理有限责任公司关于在“长金通”网上直销平台开展基金“转换补差费率”优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 16 日
10	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 23 日
11	长信基金管理有限责任公司关于在直销柜台开展个人投资者基金申购及货币市场基金转换“转换补差费率”优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 2 月 23 日
12	长信基金管理有限责任公司关于增加财通证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 3 月 3 日
13	长信基金管理有限责任公司关于增加北京中植基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 3 月 17 日
14	长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 3 月 31 日
15	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2021 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 3 月 31 日
16	长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 4 月 22 日
17	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2022 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 4 月 22 日
18	长信基金管理有限责任公司关于增加湘财证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 4 月 25 日

	机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告		
19	长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金更新的招募说明书（2022 年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 4 月 28 日
20	长信基金管理有限责任公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 5 月 7 日
21	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 5 月 11 日
22	长信基金管理有限责任公司关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 5 月 25 日
23	长信基金管理有限责任公司关于增加深圳新华信通基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 5 月 26 日
24	长信基金管理有限责任公司关于增加北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 6 月 8 日
25	长信基金管理有限责任公司关于增加上海中欧财富基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 6 月 13 日
26	长信基金管理有限责任公司关于增加上海攀赢基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 6 月 15 日
27	长信基金管理有限责任公司关于增加泰信财富基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 6 月 15 日
28	长信基金管理有限责任公司关于增加南京证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 6 月 30 日

	申购（含定投申购）费率优惠活动的公告		
29	长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	中国证监会电子披露 网站、公司网站	2022 年 7 月 21 日
30	长信基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第二季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券 时报、证券日报、中国 证监会电子披露网站、 公司网站	2022 年 7 月 21 日
31	长信基金管理有限公司关于暂停喜鹊财 富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售 业务的公告	上证报、中国证监会电 子披露网站、公司网站	2022 年 8 月 4 日
32	长信基金管理有限公司关于增加国盛证 券有限责任公司为旗下部分开放式基金代销 机构并开通转换、定期定额投资业务及参加 申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电 子披露网站、公司网站	2022 年 8 月 17 日
33	长信基金管理有限公司关于增加山西证 券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销 机构并开通转换、定期定额投资业务及参加 申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电 子披露网站、公司网站	2022 年 8 月 17 日
34	长信基金管理有限公司关于增加东兴证 券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销 机构并开通转换、定期定额投资业务及参加 申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电 子披露网站、公司网站	2022 年 8 月 24 日
35	长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金 2022 年中期报告	中国证监会电子披露 网站、公司网站	2022 年 8 月 31 日
36	长信基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年中期报告提示性公告	上证报、中证报、证券 时报、证券日报、中国 证监会电子披露网站、 公司网站	2022 年 8 月 31 日
37	长信基金管理有限公司关于增加兴业证 券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销 机构并开通转换、定期定额投资业务及参加 申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电 子披露网站、公司网站	2022 年 9 月 2 日
38	长信基金管理有限公司关于长信基金 APP 终止运营及维护服务的公告	上证报、中国证监会电 子披露网站、公司网站	2022 年 9 月 28 日
39	长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	中国证监会电子披露 网站、公司网站	2022 年 10 月 26 日
40	长信基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第三季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券 时报、证券日报、中国 证监会电子披露网站、 公司网站	2022 年 10 月 26 日
41	长信基金管理有限公司关于增加方正证 券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销 机构并开通转换、定期定额投资业务及参加 申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电 子披露网站、公司网站	2022 年 11 月 8 日

42	长信基金管理有限责任公司关于增加甬兴证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022 年 12 月 16 日
----	---	----------------------	------------------

§ 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

本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 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基金的文件；
- 2、《长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2023 年 3 月 31 日