

# 南方中证长江保护主题交易型开放式 指数证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，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 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	82
8.1 期末基金资产组合情况	82
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	82
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	84
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	88
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	90
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	90

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.....	90
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.....	90
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.....	90
8.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	90
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	90
8.12	投资组合报告附注.....	91
§9	基金份额持有人信息.....	92
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	92
9.2	期末上市基金前十名持有人.....	92
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	93
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	93
9.5	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	93
§10	开放式基金份额变动.....	93
§11	重大事件揭示.....	93
11.1	基金份额持有人大会决议.....	93
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.....	94
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	94
11.4	基金投资策略的改变.....	94
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	94
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.....	94
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	94
11.8	其他重大事件.....	96
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	97
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.....	97
12.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	98
§13	备查文件目录.....	98
13.1	备查文件目录.....	98
13.2	存放地点.....	98
13.3	查阅方式.....	98

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证长江保护主题 ETF
场内简称	长江 ETF（长江保护主题 ETF）
基金主代码	517160
交易代码	517160
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 11 月 26 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,240,777,488.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 1 月 5 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用复制策略、替代策略及其他适当的策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。主要投资策略包括：1、复制策略；2、替代策略；3、金融衍生品投资策略；4、债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、融资及转融通证券出借业务投资策略；7、存托凭证投资策略等以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为中证长江保护主题指数，及其未来可能发生的变更。
风险收益特征	本基金为股票型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资于香港证券市场上市的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
		秦一楠

	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-68121816
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518017	100031
法定代表人		周易	谷澍

## 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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所(如有)

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年 11 月 26 日-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-91,115,852.80	1,718,417.76
本期利润	-595,361,722.77	15,336,381.27
加权平均基金份额本期利润	-0.2602	0.0065
本期加权平均净值利润率	-31.68%	0.65%
本期基金份额净值增长率	-25.65%	0.65%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-563,933,127.18	1,718,417.76
期末可供分配基金份额利润	-0.2517	0.0007
期末基金资产净值	1,676,844,360.82	2,386,113,869.27
期末基金份额净值	0.7483	1.0065
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-25.17%	0.65%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 3.2 基金净值表现

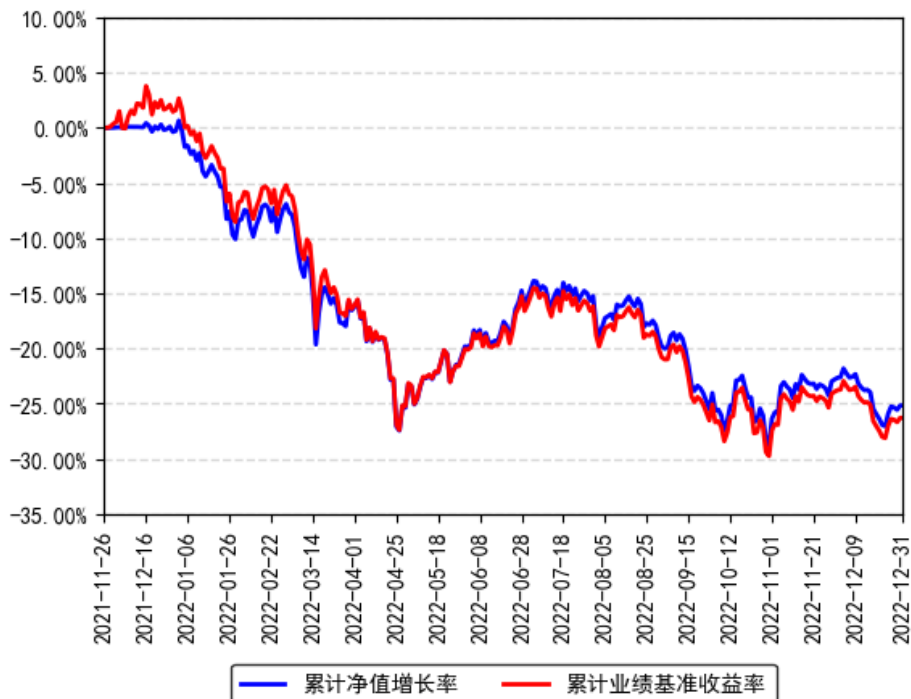
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.19%	1.21%	1.10%	1.21%	0.09%	0.00%
过去六个月	-11.56%	1.13%	-12.23%	1.14%	0.67%	-0.01%
过去一年	-25.65%	1.32%	-28.20%	1.32%	2.55%	0.00%
自基金合同生效起至今	-25.17%	1.26%	-26.29%	1.28%	1.12%	-0.02%

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

### 基准收益率变动的比较

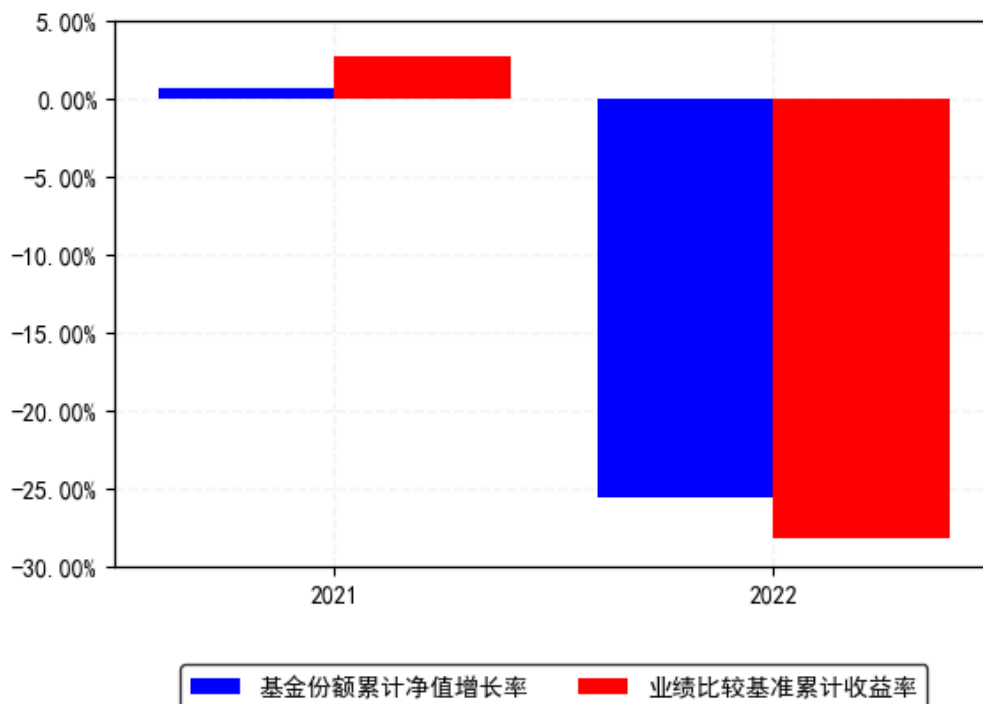
南方中证长江保护主题ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证长江保护主题ETF每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2021 年 11 月 26 日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)1.72%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.24%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.25%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.32%。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至本报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 1.72 万亿元，旗下管理 317 只公募基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

#### 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		
龚涛	本基金基金经理	2021 年 11 月 26 日	-	14 年	伦敦城市大学人工智能博士，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。曾就职于巴克莱资本（伦敦）、摩根大通（伦敦）、中信期货、华泰期货、易方达基金，历任中信期货量化研究团队负责人、华泰期货研究总监兼量化组负责人、易方达基金指数与量化投资部投资经理。2019 年 5 月加入南方基金指数投资部；2019 年 7 月 12 日至 2020 年 12 月 1 日，

				任互联基金基金经理；2019年7月12日至今，任南方中证100、南方小康ETF、南方小康ETF联接基金经理；2020年12月1日至今，任互联基金基金经理；2021年1月22日至今，任新能源ETF基金经理；2021年8月24日至今，任南方中证新能源联接基金经理；2021年9月29日至今，任南方中证科技100ETF基金经理；2021年11月12日至今，兼任投资经理；2021年11月15日至今，任南方中证物联网主题ETF基金经理；2021年11月26日至今，任长江保护主题ETF基金经理；2021年12月10日至今，任南方上证科创板50成份ETF基金经理；2021年12月17日至今，任南方富时中国国企开放共赢ETF基金经理；2022年3月3日至今，任南方上海金ETF基金经理；2022年9月30日至今，任南方上证科创板新材料ETF基金经理。
--	--	--	--	--

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

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

#### 4.1.3 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
龚涛	公募基金	13	6,030,285,356.92	2019年07月12日
	私募资产管理计划	3	50,616,960.89	2022年03月10日
	其他组合	-	-	-
	合计	16	6,080,902,317.81	-

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由工资、奖金等构成。工资由基金经理任职的职位职级决定，重点体现员工能力和职位价值导向原则；奖金由员工的绩效贡献决定，重点体现绩效导向与差异化原则。对于兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理，公司对私募资产管理计划产生的超额业绩报酬实施对应激励，并依据其管理产品的长期业绩与个人综合贡献情况实施分配。为贯彻激励约束相结合、激励与约束并重的管理理念，鼓励长期任职，防范经营风险，公司对基金经理奖金实施递延发放；同时，为加强员工利益与持有人利益相捆绑及一致性，公司对基金经理实施了跟投购基机制，有效引导基金经理为客户持续创造价值。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 12 次，是由于投资组合的投资策略导致。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

中证长江保护指数报告期内下跌 28.20%。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- (1) 新股上市初期涨幅较大的影响；
- (2) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- (3) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；
- (4) 根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.7483 元，报告期内，份额净值增长率为-25.65%，同期业绩基准增长率为-28.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年是宏观影响与事件冲击的大年，海外从俄乌冲突到美联储超预期加息以及定价海外衰退，国内疫情扰动叠加地产链的担忧都压制了国内权益资产。站在当前时点，去年压制风险资产的诸多因素都在缓解、反转的过程中，经济修复动能重启，全面看好今年的指数级别的行情。长江保护指数聚焦于环保、基建和新兴产业，其均衡性以及主题代表性具体配置价值。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况，严格遵循包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求，有效落实了 2022 年度发布的《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《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》和《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》等公募基金相关新法律法规。

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

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，制订和修订了包括《合规手册制度》《防控内幕信息及交易管理制度》《合规绩效管理制度》《责任追究管理办法》《洗钱及制裁风险名单管理规定》和《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理规则》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在进一步优化制度体系的基础上，本基金管理人贯彻“合规为先，行稳致远”的合规理念，提升合规文化建设效果，着力增强合规培训实效性，提升合规宣导影响力；根据《基金从业人员管理规则》等监管办法要求，认真梳理并优化了员工行为检查工作方案，加强员工行为规范检查、严格进行合规问责，强化全员合规、主动合规理念；对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展了定期稽核、专项稽核及多项自查，通过专项稽核和合规检查工作识别问题、防范风险、推动解决，促进公司业务合规运作、稳健经营；结合内部风控系统大数据分析结果对各类合规指标采取差异化管控措施，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料以及包括网络直播脚本在内的其他宣传材料合规性，不断强化销售合规风险管控，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；开展各类监管组织的投教活动，提升投教质效；监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日基金的投资运

作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 27574 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南方中证长江保护主题 ETF 基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日和 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度和 2021 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计</p>

	<p>准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了南方中证长江保护主题 ETF 基金 2022 年 12 月 31 日和 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度和 2021 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于南方中证长江保护主题 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>南方中证长江保护主题 ETF 基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估南方中证长江保护主题 ETF 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南方中证长江保护主题 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南方中证长江保护主题 ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p>



	<p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险; 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对南方中证长江保护主题 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致南方中证长江保护主题 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波 陈薇瑶
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金

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	2,281,489.87	154,774,408.04

结算备付金		8,478,405.70	111,656,278.72
存出保证金		1,766,608.50	363,743.71
交易性金融资产	7.4.7.2	1,664,453,102.05	2,190,453,016.16
其中：股票投资		1,664,453,102.05	2,190,453,016.16
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		-	-
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		726,085.93	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	54,182.34	319,258.81
资产总计		1,677,759,874.39	2,457,566,705.44
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		-	70,832,470.76
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		217,042.69	302,090.24
应付托管费		72,347.58	100,696.74
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,201.87	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	618,921.43	217,578.43
负债合计		915,513.57	71,452,836.17
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	2,240,777,488.00	2,370,777,488.00

其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-563,933,127.18	15,336,381.27
净资产合计		1,676,844,360.82	2,386,113,869.27
负债和净资产总计		1,677,759,874.39	2,457,566,705.44

注：1. 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7483 元，基金份额总额 2,240,777,488.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2022 年度和 2021 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金

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 11 月 26 日(基金合 同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-591,337,722.37	16,643,678.13
1.利息收入		2,929,269.32	2,599,477.31
其中：存款利息收入	7.4.7.9	237,057.42	2,339,546.10
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		-	259,931.21
证券出借利息收入		2,692,211.90	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-” 填列)		-90,058,739.25	653.00
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-114,366,037.38	653.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,994,762.16	-
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-3,851,083.64	-
股利收益	7.4.7.14	26,163,619.61	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-504,245,869.97	13,617,963.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	37,617.53	425,584.31
减：二、营业总支出		4,024,000.40	1,307,296.86
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	2,823,944.51	341,064.04
2.托管费	7.4.10.2.2	941,314.86	113,688.01
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		9,695.52	-
8.其他费用	7.4.7.17	249,045.51	852,544.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-595,361,722.77	15,336,381.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-595,361,722.77	15,336,381.27
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-595,361,722.77	15,336,381.27

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金

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）	2,370,777,488.00	-	15,336,381.27	2,386,113,869.27
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）	2,370,777,488.00	-	15,336,381.27	2,386,113,869.27
三、本期增减变	-130,000,000.00	-	-579,269,508.45	-709,269,508.45

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	-595,361,722.77	-595,361,722.77
（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）	-130,000,000.00	-	16,092,214.32	-113,907,785.68
其中：1.基金申购款	6,000,000.00	-	-541,172.82	5,458,827.18
2.基金赎回款	-136,000,000.00	-	16,633,387.14	-119,366,612.86
（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）	2,240,777,488.00	-	-563,933,127.18	1,676,844,360.82
项目	上年度可比期间 2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日）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）	-	-	-	-
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）	2,370,777,488.00	-	-	2,370,777,488.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	15,336,381.27	15,336,381.27
（一）、综合收益总额	-	-	15,336,381.27	15,336,381.27
（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)				
其中: 1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)	2,370,777,488.00	-	15,336,381.27	2,386,113,869.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]1138号《关于准予南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,370,693,910.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第1090号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2021年11月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,370,777,488.00份基金份额,其中认购资金利息折合83,578.00份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]497号审核同意,本基金2,370,777,488.00份基金份额于2022年1月5日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证长江保护主题指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。主要投资于标的指数成份股、备选成份股（包括沪港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票及包括深港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票）；此外，本基金可少量投资于非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票）、衍生工具（股指期货、股票期权等）、债券资产（包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及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的相关规定）。本基金可投资存托凭证。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为：中证长江保护主题指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2023 年 3 月 29 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度和 2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的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 2022 年 12 月 31 日和 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度和 2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2022 年度和 2021 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### (1) 金融资产

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

#### 债务工具

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

#### 以摊余成本计量：

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

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

#### 权益工具

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

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当



期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移

给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比

例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《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》及《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”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《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。此外, 财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号), 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定, 本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额, 2021 年度可比期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息, 金额分别为 154,774,408.04 元、111,656,278.72 元、363,743.71 元和 319,258.81 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金和存出保证金, 金额分别为 154,808,914.10 元、111,941,031.07 元和 363,744.11 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资产为交易性金融资产, 金额为 2,190,453,016.16 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资产为交易性金融资产, 金额为 2,190,453,016.16 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费和应付交易费用, 金额分别为 70,832,470.76 元、302,090.24 元、100,696.74 元和 217,578.43 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-应付交易费用, 金额分别为 70,832,470.76 元、302,090.24 元、100,696.74 元和 217,578.43 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日, “银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日, 根据新金融工具准则下的计量类别, 将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示, 本基金无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持

有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	2,281,489.87	154,774,408.04
等于：本金	2,281,302.76	154,774,408.04
加：应计利息	187.11	-
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	2,281,489.87	154,774,408.04

### 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		2,154,833,66 8.51	-	1,664,453,10 2.05	-490,380,566. 46
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		2,154,833,66 8.51	-	1,664,453,10 2.05	-490,380,566. 46
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		2,176,835,05 2.65	-	2,190,453,01 6.16	13,617,963.5 1
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		2,176,835,05 2.65	-	2,190,453,01 6.16	13,617,963.5 1

注：于 2022 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 0.00 元(2021 年 12 月 31 日：0.00 元)。

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	13,142,060.00	-	-	-
一股指期货	13,142,060.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,142,060.00	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2303	IC2303	3.00	3,524,640.00	-149,200.00
IF2303	IF2303	8.00	9,370,080.00	-98,140.00
合计				-247,340.00
减：可抵销期货暂收款				-247,340.00
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

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	-	319,258.81
其他应收款	54,182.34	-
待摊费用	-	-
可收退补款	-	-
应收退补款	-	-
合计	54,182.34	319,258.81

#### 7.4.7.6 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	-	-

应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	25,543.67	217,578.43
其中：交易所市场	25,543.67	217,578.43
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应退退补款	374,377.76	-
预提费用	219,000.00	-
应付指数使用费	-	-
可退替代款	-	-
其他	-	-
合计	618,921.43	217,578.43

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

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

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	2,370,777,488.00	2,370,777,488.00
本期申购	6,000,000.00	6,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-136,000,000.00	-136,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,240,777,488.00	2,240,777,488.00

注：1. 本基金自 2021 年 9 月 22 日至 2021 年 11 月 22 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 2,370,693,910.00 元，折合为 2,370,693,910.00 份基金份额。根据《南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 83,578.00 元在本基金成立后，折合为 83,578.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购与赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 1 月 4 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务和赎回业务自 2022 年 1 月 5 日起开始办理。

#### 7.4.7.8 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	1,718,417.76	13,617,963.51	15,336,381.27
本期利润	-91,115,852.80	-504,245,869.97	-595,361,722.77
本期基金份额交易产生的变动数	1,419,502.37	14,672,711.95	16,092,214.32
其中：基金申购款	-37,570.14	-503,602.68	-541,172.82
基金赎回款	1,457,072.51	15,176,314.63	16,633,387.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-87,977,932.67	-475,955,194.51	-563,933,127.18

#### 7.4.7.9 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 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	24,502.48	197,214.82
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	206,173.89	2,141,529.10
其他	6,381.05	802.18
合计	237,057.42	2,339,546.10

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

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 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-109,049,565.97	653.00
股票投资收益——赎回差价收入	-5,316,471.41	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-114,366,037.38	653.00

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	513,385,537.24	26,710.00
减：卖出股票成本总额	621,535,210.28	26,057.00
减：交易费用	899,892.93	-

买卖股票差价收入	-109,049,565.97	653.00
----------	-----------------	--------

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

#### 7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

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 11 月 26 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	119,366,612.86	-
减：现金支付赎回款总额	67,385,192.86	-
减：赎回股票成本总额	57,297,891.41	-
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-5,316,471.41	-

#### 7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

#### 7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	993.01	-
债券投资收益——买卖债券（、 债转股及债券到期兑付）差价收 入	1,993,769.15	-
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	1,994,762.16	-

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券	11,554,729.13	-

到期兑付)成交总额		
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	9,559,800.00	-
减:应计利息总额	1,022.91	-
减:交易费用	137.07	-
买卖债券差价收入	1,993,769.15	-

注:上述交易费用(如有)包含债券买卖产生的交易费用。

#### 7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.11.5 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.12 贵金属投资收益

##### 7.4.7.12.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.12.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.12.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

##### 7.4.7.12.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

##### 7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.13.2 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2021 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

股指期货-投资收益	-3,851,083.64	-
-----------	---------------	---

#### 7.4.7.14 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 11 月 26 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	26,163,619.61	-
其中：证券出借权益补偿收入	635,174.58	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	26,163,619.61	-

#### 7.4.7.15 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 11 月 26 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-503,998,529.97	13,617,963.51
——股票投资	-503,998,529.97	13,617,963.51
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-247,340.00	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-247,340.00	-
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	-504,245,869.97	13,617,963.51

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为 0.00 元(2021 年度：0.00 元)。

#### 7.4.7.16 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 11 月 26 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	37,617.53	-
基金合同生效前利息收入	-	425,584.31
合计	37,617.53	425,584.31

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

#### 7.4.7.17 其他费用

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 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	99,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	14,571.40	7,448.52
其他	15,474.11	400.00
交易费用	-	844,696.29
合计	249,045.51	852,544.81

#### 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

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 11 月 26 日 (基金合同生效日) 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
华泰证券	448,400,881.18	38.77%	944,246,069.88	43.40%

#### 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 11 月 26 日 (基金合同生效日) 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
华泰证券	4,606,199.47	39.86%	-	-

#### 7.4.10.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	44,840.37	38.77%	9,390.63	36.76%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 11 月 26 日 (基金合同生效日) 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
华泰证券	94,424.72	43.40%	94,424.72	43.40%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元



项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,823,944.51	341,064.04
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

#### 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 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	941,314.86	113,688.01

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	531,815,677.00	336,211.56	41,538,213.00	8,458.66

上年度可比期间 2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

华泰证券	-	-	-	-
------	---	---	---	---

#### 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

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位:)	出借期限 (单位:)	费率	利息收入	期末 证券 出借 业务 余额	期末 应收 利息 余额
华泰证券	2022011400001091	蓝盾光电	2022年1月14日	301,320.00	9,000.00	14	3.50	398.18	-	-
华泰证券	2022011400001109	兴源环境	2022年1月14日	1,634,490.00	429,000.00	14	3.50	2,159.92	-	-
华泰证券	2022011400001110	聚光科技	2022年1月14日	1,474,760.00	64,400.00	14	3.50	1,948.85	-	-
华泰证券	2022011400001112	海新能科	2022年1月14日	166,844.00	21,200.00	14	3.50	220.48	-	-
华泰证券	2022011700000965	兴源环境	2022年1月17日	623,700.00	157,500.00	21	3.50	1,236.30	-	-
华泰证券	2022011800001280	海新能科	2022年1月18日	485,667.00	59,300.00	20	3.50	916.85	-	-
华泰证券	2022012500000847	海新能科	2022年1月25日	374,680.00	49,300.00	14	3.50	495.13	-	-
华泰证券	2022012700001093	海新能科	2022年1月27日	155,200.00	20,000.00	14	3.50	205.09	-	-
华泰证券	2022012800	海新能科	2022年1月	164,300.00	21,200.00	14	3.50	217.12	-	-

	02163 2		月 28 日							
华泰 证券	20220 12800 02163 4	聚光 科技	2022 年 1 月 28 日	1,552, 040.0 0	64,40 0.00	14	3.50	2,050. 97	-	-
华泰 证券	20220 12800 02163 6	兴源 环境	2022 年 1 月 28 日	1,501, 500.0 0	429,0 00.00	14	3.50	1,984. 18	-	-
华泰 证券	20220 12800 02165 8	蓝盾 光电	2022 年 1 月 28 日	276,3 90.00	9,000. 00	14	3.50	365.2 4	-	-
华泰 证券	20220 20700 04645 3	兴源 环境	2022 年 2 月 7 日	563,8 50.00	157,5 00.00	14	3.50	745.1 1	-	-
华泰 证券	20220 20700 04873 7	海新 能科	2022 年 2 月 7 日	480,3 30.00	59,30 0.00	14	3.50	634.7 4	-	-
华泰 证券	20220 20800 01454 6	海新 能科	2022 年 2 月 8 日	406,2 32.00	49,30 0.00	14	3.50	536.8 2	-	-
华泰 证券	20220 21000 01359 8	海新 能科	2022 年 2 月 10 日	164,0 00.00	20,00 0.00	14	3.50	216.7 2	-	-
华泰 证券	20220 21100 02023 0	蓝盾 光电	2022 年 2 月 11 日	277,6 50.00	9,000. 00	14	3.50	366.9 1	-	-
华泰 证券	20220 21100 02024 6	聚光 科技	2022 年 2 月 11 日	1,485, 708.0 0	64,40 0.00	14	3.50	1,963. 31	-	-
华泰 证券	20220 21100 02025 0	海新 能科	2022 年 2 月 11 日	170,0 24.00	21,20 0.00	14	3.50	224.6 8	-	-
华泰 证券	20220 22100	海新 能科	2022 年 2	515,3 17.00	59,30 0.00	14	3.50	680.9 7	-	-

	042681		月 21 日							
华泰证券	2022022100047561	兴源环境	2022年 2月 21 日	652,050.00	157,500.00	14	3.50	861.66	-	-
华泰证券	202202240010461	海新能科	2022年 2月 24 日	160,600.00	20,000.00	14	3.50	212.23	-	-
华泰证券	202202250018661	聚光科技	2022年 2月 25 日	1,672,468.00	64,400.00	14	3.50	2,210.11	-	-
华泰证券	202202250018671	海新能科	2022年 2月 25 日	171,084.00	21,200.00	14	3.50	226.08	-	-
华泰证券	202202250018675	蓝盾光电	2022年 2月 25 日	288,720.00	9,000.00	14	3.50	381.53	-	-
华泰证券	20220301001195	蓝盾光电	2022年 3月 1 日	96,240.00	3,000.00	14	3.50	127.18	-	-
华泰证券	20220307001451	聚光科技	2022年 3月 7 日	986,592.00	34,400.00	14	3.50	1,303.75	-	-
华泰证券	20220307001452	海新能科	2022年 3月 7 日	480,260.00	64,900.00	14	3.50	634.65	-	-
华泰证券	202203070045122	兴源环境	2022年 3月 7 日	653,625.00	157,500.00	14	3.50	863.74	-	-
华泰证券	202203080011337	兴源环境	2022年 3月 8 日	22,605.00	5,500.00	14	3.50	29.87	-	-
华泰证券	2022031000	海新能科	2022年 3月	136,000.00	20,000.00	14	3.50	179.72	-	-

	012376		月 10 日							
华泰证券	202203110000896	海新能科	2022年3月11日	47,740.00	7,000.00	14	3.50	63.09	-	-
华泰证券	202203110016406	蓝盾光电	2022年3月11日	273,060.00	9,000.00	14	3.50	360.84	-	-
华泰证券	202203110017032	聚光科技	2022年3月11日	1,740,732.00	64,400.00	14	3.50	2,300.32	-	-
华泰证券	202203110018938	海新能科	2022年3月11日	144,584.00	21,200.00	14	3.50	191.06	-	-
华泰证券	202203150001265	浩通科技	2022年3月15日	58,320.00	1,200.00	14	3.50	77.07	-	-
华泰证券	202203150001266	海新能科	2022年3月15日	27,632.00	4,400.00	14	3.50	36.51	-	-
华泰证券	202203150010753	蓝盾光电	2022年3月15日	83,400.00	3,000.00	14	3.50	110.21	-	-
华泰证券	202203180000885	天合光能	2022年3月18日	2,823,159.00	41,100.00	28	3.50	7,461.42	-	-
华泰证券	2022032100033789	兴源环境	2022年3月21日	748,125.00	157,500.00	16	3.50	1,129.85	-	-
华泰证券	2022032100033791	聚光科技	2022年3月21日	894,400.00	34,400.00	16	3.50	1,350.77	-	-
华泰证券	2022032200	兴源环境	2022年3月	25,135.00	5,500.00	15	3.50	35.59	-	-

	012357		月 22 日							
华泰证券	202203240012705	海新能科	2022年3月24日	131,000.00	20,000.00	14	3.50	173.11	-	-
华泰证券	202203250017370	海新能科	2022年3月25日	138,860.00	21,200.00	14	3.50	183.50	-	-
华泰证券	202203250018552	聚光科技	2022年3月25日	1,595,188.00	64,400.00	14	3.50	2,107.99	-	-
华泰证券	202203250018556	蓝盾光电	2022年3月25日	272,160.00	9,000.00	14	3.50	359.65	-	-
华泰证券	202203250018560	海新能科	2022年3月25日	45,850.00	7,000.00	14	3.50	60.59	-	-
华泰证券	202203290005610	浩通科技	2022年3月29日	59,328.00	1,200.00	14	3.50	78.40	-	-
华泰证券	202203290005756	蓝盾光电	2022年3月29日	86,520.00	3,000.00	14	3.50	114.33	-	-
华泰证券	2022040600058199	兴源环境	2022年4月6日	23,375.00	5,500.00	14	3.50	30.89	-	-
华泰证券	2022040600058201	兴源环境	2022年4月6日	669,375.00	157,500.00	14	3.50	884.56	-	-
华泰证券	202204070000866	聚光科技	2022年4月7日	21,890.00	1,000.00	14	3.50	28.93	-	-
华泰证券	2022040700	中金环境	2022年4月	6,248.00	2,200.00	14	3.50	8.26	-	-

	000867		月7日							
华泰证券	202204070011356	海新能科	2022年4月7日	127,800.00	20,000.00	14	3.50	168.88	-	-
华泰证券	202204080014307	海新能科	2022年4月8日	130,592.00	21,200.00	14	3.50	172.57	-	-
华泰证券	202204080014309	蓝盾光电	2022年4月8日	258,480.00	9,000.00	14	3.50	341.57	-	-
华泰证券	202204080014447	聚光科技	2022年4月8日	1,409,716.00	64,400.00	14	3.50	1,862.89	-	-
华泰证券	202204080014449	海新能科	2022年4月8日	43,120.00	7,000.00	14	3.50	56.98	-	-
华泰证券	202204110000819	兴源环境	2022年4月11日	25,408.00	6,400.00	14	3.50	33.58	-	-
华泰证券	202204110000821	中金环境	2022年4月11日	28,737.00	10,300.00	14	3.50	37.98	-	-
华泰证券	202204110000827	海新能科	2022年4月11日	98,438.00	16,600.00	14	3.50	130.08	-	-
华泰证券	202204120011571	蓝盾光电	2022年4月12日	84,840.00	3,000.00	14	3.50	112.11	-	-
华泰证券	202204120011573	浩通科技	2022年4月12日	54,600.00	1,200.00	14	3.50	72.15	-	-
华泰证券	2022041300	蓝盾光电	2022年4月	27,910.00	1,000.00	14	3.50	36.88	-	-

	001021		月 13 日							
华泰证券	202204130001025	海新能科	2022年4月13日	278,586.00	46,200.00	14	3.50	368.14	-	-
华泰证券	202204150000950	兴源环境	2022年4月15日	14,326.00	3,800.00	14	3.50	18.93	-	-
华泰证券	202204150004788	天合光能	2022年4月15日	1,981,020.00	41,100.00	28	3.50	5,235.71	-	-
华泰证券	202204200046048	兴源环境	2022年4月20日	21,065.00	5,500.00	15	3.50	29.83	-	-
华泰证券	202204200048954	兴源环境	2022年4月20日	603,225.00	157,500.00	15	3.50	854.08	-	-
华泰证券	202204210013377	聚光科技	2022年4月21日	19,100.00	1,000.00	14	3.50	25.24	-	-
华泰证券	202204210013379	中金环境	2022年4月21日	5,918.00	2,200.00	14	3.50	7.82	-	-
华泰证券	202204220013932	蓝盾光电	2022年4月22日	232,740.00	9,000.00	14	3.50	307.56	-	-
华泰证券	202204220016302	聚光科技	2022年4月22日	1,202,348.00	64,400.00	14	3.50	1,588.86	-	-
华泰证券	202204250005089	中金环境	2022年4月25日	26,368.00	10,300.00	14	3.50	34.84	-	-
华泰证券	2022042500	兴源环境	2022年4月	20,544.00	6,400.00	14	3.50	27.15	-	-



	00509 1		月 25 日							
华泰 证券	20220 42500 00541 5	海新 能科	2022 年 4 月 25 日	71,38 0.00	16,60 0.00	14	3.50	94.33	-	-
华泰 证券	20220 42600 00761 1	蓝盾 光电	2022 年 4 月 26 日	68,19 0.00	3,000. 00	14	3.50	90.11	-	-
华泰 证券	20220 42700 01152 5	海新 能科	2022 年 4 月 27 日	191,2 68.00	46,20 0.00	14	3.50	252.7 5	-	-
华泰 证券	20220 42700 01152 7	蓝盾 光电	2022 年 4 月 27 日	23,42 0.00	1,000. 00	14	3.50	30.95	-	-
华泰 证券	20220 42900 00107 2	浩通 科技	2022 年 4 月 29 日	33,73 0.00	1,000. 00	14	3.50	44.57	-	-
华泰 证券	20220 42900 00461 4	兴源 环境	2022 年 4 月 29 日	11,81 8.00	3,800. 00	14	3.50	15.62	-	-
华泰 证券	20220 50500 07137 1	中金 环境	2022 年 5 月 5 日	5,720. 00	2,200. 00	14	3.50	7.56	-	-
华泰 证券	20220 50500 07137 9	兴源 环境	2022 年 5 月 5 日	491,4 00.00	157,5 00.00	14	3.50	649.3 7	-	-
华泰 证券	20220 50500 07138 5	兴源 环境	2022 年 5 月 5 日	17,16 0.00	5,500. 00	14	3.50	22.68	-	-
华泰 证券	20220 50600 01565 3	蓝盾 光电	2022 年 5 月 6 日	220,1 40.00	9,000. 00	14	3.50	290.9 1	-	-
华泰 证券	20220 50600	聚光 科技	2022 年 5	1,160, 488.0	64,40 0.00	14	3.50	1,533. 55	-	-

	015655		月6日	0							
华泰证券	20220509009649	中金环境	2022年5月9日	26,883.00	10,300.00	14	3.50	35.53	-	-	
华泰证券	20220509010077	兴源环境	2022年5月9日	20,544.00	6,400.00	14	3.50	27.15	-	-	
华泰证券	202205100014363	蓝盾光电	2022年5月10日	76,680.00	3,000.00	14	3.50	101.33	-	-	
华泰证券	2022051300005428	天合光能	2022年5月13日	2,295,846.00	41,100.00	28	3.50	6,067.77	-	-	
华泰证券	202205190000482	兴源环境	2022年5月19日	13,079.00	4,100.00	14	3.50	17.28	-	-	
华泰证券	2022051900048567	兴源环境	2022年5月19日	502,425.00	157,500.00	14	3.50	663.94	-	-	
华泰证券	2022051900048599	兴源环境	2022年5月19日	17,545.00	5,500.00	14	3.50	23.19	-	-	
华泰证券	2022051900052517	中金环境	2022年5月19日	5,918.00	2,200.00	14	3.50	7.82	-	-	
华泰证券	2022052000013988	蓝盾光电	2022年5月20日	234,810.00	9,000.00	17	3.50	376.79	-	-	
华泰证券	2022052000016280	聚光科技	2022年5月20日	1,483,776.00	64,400.00	17	3.50	2,380.92	-	-	
华泰证券	2022052300	兴源环境	2022年5月	21,312.00	6,400.00	14	3.50	28.16	-	-	

	006791		月 23 日							
华泰证券	2022052300006941	中金环境	2022年5月23日	27,913.00	10,300.00	14	3.50	36.89	-	-
华泰证券	202205240008434	蓝盾光电	2022年5月24日	73,530.00	3,000.00	14	3.50	97.17	-	-
华泰证券	202206100003663	天合光能	2022年6月10日	2,576,970.00	41,100.00	28	3.50	6,810.76	-	-
华泰证券	202206140001351	聚光科技	2022年6月14日	3,432,150.00	157,800.00	14	3.50	4,535.47	-	-
华泰证券	202206160000819	兴源环境	2022年6月16日	2,219,634.00	570,600.00	14	3.50	2,933.17	-	-
华泰证券	202206200001494	碧水源	2022年6月20日	419,050.00	85,000.00	14	3.50	553.76	-	-
华泰证券	202206200001495	碧水源	2022年6月20日	369,750.00	75,000.00	14	3.50	488.61	-	-
华泰证券	202206200001497	碧水源	2022年6月20日	1,084,600.00	220,000.00	14	3.50	1,433.26	-	-
华泰证券	202206240001102	碧水源	2022年6月24日	989,310.00	201,900.00	14	3.50	1,307.34	-	-
华泰证券	2022063000021489	兴源环境	2022年6月30日	2,242,458.00	570,600.00	14	3.50	2,963.33	-	-
华泰证券	2022070400	碧水源	2022年7月	1,139,600.00	220,000.00	14	3.50	1,505.94	-	-

	01459 6		月 4 日	0							
华泰 证券	20220 70400 01459 8	碧水 源	2022 年 7 月 4 日	388,5 00.00	75,00 0.00	14	3.50	513.3 9	-	-	
华泰 证券	20220 70400 01460 2	碧水 源	2022 年 7 月 4 日	440,3 00.00	85,00 0.00	14	3.50	581.8 4	-	-	
华泰 证券	20220 70800 00821 6	天合 光能	2022 年 7 月 8 日	2,790, 690.0 0	41,10 0.00	28	3.50	7,375. 61	-	-	
华泰 证券	20220 70800 00853 4	碧水 源	2022 年 7 月 8 日	1,009, 500.0 0	201,9 00.00	14	3.50	1,334. 02	-	-	
华泰 证券	20220 71400 01399 8	兴源 环境	2022 年 7 月 14 日	2,350, 872.0 0	570,6 00.00	14	3.50	3,106. 60	-	-	
华泰 证券	20220 71800 01335 1	碧水 源	2022 年 7 月 18 日	382,5 00.00	75,00 0.00	14	3.50	505.4 6	-	-	
华泰 证券	20220 71800 01335 3	碧水 源	2022 年 7 月 18 日	433,5 00.00	85,00 0.00	14	3.50	572.8 6	-	-	
华泰 证券	20220 71800 01335 5	碧水 源	2022 年 7 月 18 日	1,122, 000.0 0	220,0 00.00	14	3.50	1,482. 69	-	-	
华泰 证券	20220 72200 00682 1	碧水 源	2022 年 7 月 22 日	1,033, 728.0 0	201,9 00.00	14	3.50	1,366. 04	-	-	
华泰 证券	20220 72800 01542 3	兴源 环境	2022 年 7 月 28 日	2,270, 988.0 0	570,6 00.00	14	3.50	3,001. 04	-	-	
华泰 证券	20220 80100	碧水 源	2022 年 8	412,5 00.00	75,00 0.00	14	3.50	545.1 1	-	-	

	013767		月1日								
华泰证券	2022080100015829	碧水源	2022年8月1日	467,500.00	85,000.00	14	3.50	617.79	-	-	
华泰证券	2022080100015831	碧水源	2022年8月1日	1,210,000.00	220,000.00	14	3.50	1,598.98	-	-	
华泰证券	2022080500008127	天合光能	2022年8月5日	3,241,146.00	41,100.00	28	3.50	8,566.14	-	-	
华泰证券	2022080500008157	碧水源	2022年8月5日	1,118,526.00	201,900.00	14	3.50	1,478.10	-	-	
华泰证券	2022080800000986	碧水源	2022年8月8日	2,130,076.00	388,700.00	14	3.50	2,814.83	-	-	
华泰证券	2022081100001549	爱尔眼科	2022年8月11日	6,281,623.00	208,900.00	14	3.50	8,300.96	-	-	
华泰证券	2022081100016508	兴源环境	2022年8月11日	2,134,044.00	570,600.00	14	3.50	2,820.07	-	-	
华泰证券	2022081500017113	碧水源	2022年8月15日	409,500.00	75,000.00	14	3.50	541.14	-	-	
华泰证券	2022081500017115	碧水源	2022年8月15日	464,100.00	85,000.00	14	3.50	613.29	-	-	
华泰证券	2022081500017117	碧水源	2022年8月15日	1,201,200.00	220,000.00	14	3.50	1,587.35	-	-	
华泰证券	2022081900	碧水源	2022年8月	1,126,602.00	201,900.00	14	3.50	1,488.77	-	-	

	00780 6		月 19 日	0						
华泰 证券	20220 82200 00071 1	碧水源	2022 年 8 月 22 日	5,545, 560.0 0	999,2 00.00	14	3.50	7,328. 28	-	-
华泰 证券	20220 82200 01920 5	碧水源	2022 年 8 月 22 日	2,157, 285.0 0	388,7 00.00	14	3.50	2,850. 78	-	-
华泰 证券	20220 82500 01086 6	爱尔 眼科	2022 年 8 月 25 日	6,206, 419.0 0	208,9 00.00	14	3.50	8,201. 58	-	-
华泰 证券	20220 82600 00095 2	聚光 科技	2022 年 8 月 26 日	309,2 10.00	11,00 0.00	14	3.50	408.6 1	-	-
华泰 证券	20220 82900 00103 0	蓝思 科技	2022 年 8 月 29 日	20,90 0.00	1,900. 00	15	3.50	29.59	-	-
华泰 证券	20220 82900 01802 7	碧水源	2022 年 8 月 29 日	415,5 00.00	75,00 0.00	18	3.50	705.9 5	-	-
华泰 证券	20220 82900 01802 9	碧水源	2022 年 8 月 29 日	1,218, 800.0 0	220,0 00.00	18	3.50	2,070. 78	-	-
华泰 证券	20220 82900 01906 3	碧水源	2022 年 8 月 29 日	470,9 00.00	85,00 0.00	18	3.50	800.0 7	-	-
华泰 证券	20220 83000 00148 4	兴源 环境	2022 年 8 月 30 日	22,49 0.00	6,500. 00	14	3.50	29.72	-	-
华泰 证券	20220 83100 00150 0	聚光 科技	2022 年 8 月 31 日	72,47 5.00	2,500. 00	14	3.50	95.77	-	-
华泰 证券	20220 90200	碧水源	2022 年 9	1,116, 507.0	201,9 00.00	14	3.50	1,475. 43	-	-

	010033		月2日	0						
华泰证券	202209050019811	碧水源	2022年9月5日	2,176,720.00	388,700.00	14	3.50	2,876.46	-	-
华泰证券	2022090800000919	碧水源	2022年9月8日	5,661,450.00	984,600.00	14	3.50	7,481.42	-	-
华泰证券	2022090800011112	爱尔眼科	2022年9月8日	5,907,692.00	208,900.00	14	3.50	7,806.82	-	-
华泰证券	2022090900019365	聚光科技	2022年9月9日	302,940.00	11,000.00	14	3.50	400.33	-	-
华泰证券	2022091300023901	兴源环境	2022年9月13日	21,515.00	6,500.00	14	3.50	28.43	-	-
华泰证券	2022091300027621	蓝思科技	2022年9月13日	20,805.00	1,900.00	14	3.50	27.49	-	-
华泰证券	2022091400019580	聚光科技	2022年9月14日	69,700.00	2,500.00	14	3.50	92.11	-	-
华泰证券	2022091600001248	碧水源	2022年9月16日	42,994.00	8,300.00	14	3.50	56.82	-	-
华泰证券	2022091600010412	碧水源	2022年9月16日	388,500.00	75,000.00	14	3.50	513.39	-	-
华泰证券	2022091600010414	碧水源	2022年9月16日	1,139,600.00	220,000.00	14	3.50	1,505.94	-	-
华泰证券	2022091600091600	碧水源	2022年9月16日	440,300.00	85,000.00	14	3.50	581.84	-	-

	010416		月16日							
华泰证券	202209160010988	碧水源	2022年9月16日	1,045,842.00	201,900.00	14	3.50	1,382.05	-	-
华泰证券	202209190019672	碧水源	2022年9月19日	1,935,726.00	388,700.00	21	3.50	3,837.00	-	-
华泰证券	202209220009581	碧水源	2022年9月22日	4,883,616.00	984,600.00	18	3.50	8,297.41	-	-
华泰证券	202209220010273	爱尔眼科	2022年9月22日	5,354,107.00	208,900.00	1	3.50	505.38	-	-
华泰证券	202209230001823	爱尔眼科	2022年9月23日	5,354,107.00	208,900.00	3	3.50	1,516.13	-	-
华泰证券	202209230016822	聚光科技	2022年9月23日	288,860.00	11,000.00	17	3.50	463.52	-	-
华泰证券	202209270024223	兴源环境	2022年9月27日	20,150.00	6,500.00	14	3.50	26.63	-	-
华泰证券	202209280000489	兴源环境	2022年9月28日	5,454.00	1,800.00	14	3.50	7.21	-	-
华泰证券	202209290001067	阳光电源	2022年9月29日	147,550.00	1,300.00	28	3.50	389.96	-	-
华泰证券	20220930000534	卓胜微	2022年9月30日	114,933.00	1,300.00	14	3.50	151.88	-	-
华泰证券	20221010001000	碧水源	2022年10月	1,520,498.00	324,200.00	14	3.50	2,009.29	-	-



	002036		月 10 日	0							
华泰证券	202210100094451	聚光科技	2022年 10月 10日	335,720.00	11,000.00	14	3.50	443.64	-	-	
华泰证券	2022101000102791	碧水源	2022年 10月 10日	4,617,774.00	984,600.00	14	3.50	6,102.24	-	-	
华泰证券	2022101000102811	碧水源	2022年 10月 10日	1,823,003.00	388,700.00	14	3.50	2,409.04	-	-	
华泰证券	2022101100001712	碧水源	2022年 10月 11日	72,540.00	15,500.00	14	3.50	95.86	-	-	
华泰证券	2022101100001714	阳光电源	2022年 10月 11日	303,160.00	2,600.00	14	3.50	400.62	-	-	
华泰证券	2022101100023537	兴源环境	2022年 10月 11日	19,695.00	6,500.00	14	3.50	26.03	-	-	
华泰证券	2022101200019996	兴源环境	2022年 10月 12日	5,616.00	1,800.00	14	3.50	7.42	-	-	
华泰证券	2022101800000875	阳光电源	2022年 10月 18日	1,051,206.00	7,800.00	14	3.50	1,389.13	-	-	
华泰证券	2022101800000876	宁德时代	2022年 10月 18日	1,030,896.00	2,400.00	14	3.50	1,362.30	-	-	
华泰证券	2022101800000879	沃森生物	2022年 10月 18日	56,826.00	1,400.00	14	3.50	75.09	-	-	
华泰证券	2022101800	泰格医药	2022年 10月	136,500.00	1,500.00	14	3.50	180.38	-	-	

	000880		月 18 日							
华泰证券	2022101800000883	智飞生物	2022年10月18日	154,832.00	1,600.00	14	3.50	204.61	-	-
华泰证券	2022101800000884	爱尔眼科	2022年10月18日	157,768.00	5,200.00	14	3.50	208.49	-	-
华泰证券	2022101800000923	中芯国际	2022年10月18日	678,180.00	17,800.00	14	3.50	896.19	-	-
华泰证券	2022102400075241	碧水源	2022年10月24日	4,529,160.00	984,600.00	14	3.50	5,985.14	-	-
华泰证券	2022102400085433	聚光科技	2022年10月24日	413,050.00	11,000.00	14	3.50	545.83	-	-
华泰证券	2022102400093927	碧水源	2022年10月24日	1,491,320.00	324,200.00	14	3.50	1,970.73	-	-
华泰证券	2022102400095649	碧水源	2022年10月24日	1,788,020.00	388,700.00	14	3.50	2,362.81	-	-
华泰证券	2022102500027082	碧水源	2022年10月25日	76,105.00	15,500.00	14	3.50	100.57	-	-
华泰证券	2022102500029542	兴源环境	2022年10月25日	19,890.00	6,500.00	14	3.50	26.28	-	-
华泰证券	2022102600023436	兴源环境	2022年10月26日	5,562.00	1,800.00	14	3.50	7.35	-	-
华泰证券	202210270002700	阳光电源	2022年10月	172,926.00	1,300.00	28	3.50	457.03	-	-

	01499 3		月 27 日							
华泰 证券	20221 10100 00848 6	中芯 国际	2022 年 11 月 1 日	742,6 16.00	17,80 0.00	14	3.50	981.3 4	-	-
华泰 证券	20221 10100 00850 0	智飞 生物	2022 年 11 月 1 日	150,7 20.00	1,600. 00	14	3.50	199.1 7	-	-
华泰 证券	20221 10100 00850 2	沃森 生物	2022 年 11 月 1 日	56,50 4.00	1,400. 00	14	3.50	74.67	-	-
华泰 证券	20221 10100 00850 6	爱尔 眼科	2022 年 11 月 1 日	135,4 60.00	5,200. 00	14	3.50	179.0 1	-	-
华泰 证券	20221 10100 00920 2	宁德 时代	2022 年 11 月 1 日	926,8 80.00	2,400. 00	14	3.50	1,224. 84	-	-
华泰 证券	20221 10100 00920 8	阳光 电源	2022 年 11 月 1 日	1,052, 922.0 0	7,800. 00	14	3.50	1,391. 40	-	-
华泰 证券	20221 10100 00921 2	泰格 医药	2022 年 11 月 1 日	135,7 65.00	1,500. 00	14	3.50	179.4 1	-	-
华泰 证券	20221 10200 00166 2	阳光 电源	2022 年 11 月 2 日	346,0 08.00	2,600. 00	14	3.50	457.2 4	-	-
华泰 证券	20221 10700 08337 1	聚光 科技	2022 年 11 月 7 日	382,8 00.00	11,00 0.00	14	3.50	505.8 6	-	-
华泰 证券	20221 10700 08345 3	碧水 源	2022 年 11 月 7 日	1,962, 935.0 0	388,7 00.00	14	3.50	2,593. 95	-	-
华泰 证券	20221 10700	碧水 源	2022 年 11	1,637, 210.0	324,2 00.00	14	3.50	2,163. 52	-	-

	084371		月7日	0						
华泰证券	2022110700098333	碧水源	2022年11月7日	4,972,230.00	984,600.00	14	3.50	6,570.64	-	-
华泰证券	2022110800021933	碧水源	2022年11月8日	78,430.00	15,500.00	14	3.50	103.64	-	-
华泰证券	2022110800026887	兴源环境	2022年11月8日	20,150.00	6,500.00	14	3.50	26.63	-	-
华泰证券	2022110900020711	兴源环境	2022年11月9日	5,544.00	1,800.00	14	3.50	7.33	-	-
华泰证券	2022111000000732	中伟股份	2022年11月10日	1,040,009.00	13,100.00	14	3.50	1,374.34	-	-
华泰证券	2022111700001424	宁德时代	2022年11月17日	2,175,696.00	5,800.00	14	3.50	2,875.11	-	-
华泰证券	2022111700001426	沃森生物	2022年11月17日	257,404.00	5,800.00	14	3.50	340.15	-	-
华泰证券	2022112100000855	沃森生物	2022年11月21日	252,395.00	5,500.00	14	3.50	333.53	-	-
华泰证券	2022112100061748	聚光科技	2022年11月21日	409,860.00	11,000.00	14	3.50	541.62	-	-
华泰证券	2022112100075508	碧水源	2022年11月21日	4,982,076.00	984,600.00	14	3.50	6,583.65	-	-
华泰证券	2022112100	碧水源	2022年11月	1,966,822.00	388,700.00	14	3.50	2,599.09	-	-

	081756		月 21 日	0						
华泰证券	2022112100081770	碧水源	2022 年 11 月 21 日	1,640,452.00	324,200.00	14	3.50	2,167.80	-	-
华泰证券	202211220015515	兴源环境	2022 年 11 月 22 日	19,955.00	6,500.00	14	3.50	26.37	-	-
华泰证券	202211220017195	碧水源	2022 年 11 月 22 日	78,895.00	15,500.00	14	3.50	104.26	-	-
华泰证券	202211230019854	兴源环境	2022 年 11 月 23 日	5,526.00	1,800.00	14	3.50	7.30	-	-
华泰证券	202212050023838	碧水源	2022 年 12 月 5 日	5,090,382.00	984,600.00	14	3.50	6,726.77	-	-
华泰证券	202212140005623	节能铁汉	2022 年 12 月 14 日	1,242,096.00	542,400.00	14	3.50	1,641.39	-	-
华泰证券	202212140005625	天源环保	2022 年 12 月 14 日	19,746.00	1,800.00	14	3.50	26.09	-	-
华泰证券	202212140005627	艾布鲁	2022 年 12 月 14 日	44,484.00	2,200.00	14	3.50	58.78	-	-
华泰证券	202212140005629	中金环境	2022 年 12 月 14 日	344,586.00	136,200.00	14	3.50	455.36	-	-
华泰证券	202212140005633	仕净科技	2022 年 12 月 14 日	2,662,360.00	65,900.00	14	3.50	3,518.22	-	-
华泰证券	2022121400	兴源环境	2022 年 12 月	3,033,360.00	919,200.00	14	3.50	4,008.49	-	-

	00563 4		月 14 日	0						
华泰 证券	20221 21400 00563 5	浩通 科技	2022 年 12 月 14 日	705,8 40.00	17,30 0.00	14	3.50	932.7 4	-	-
华泰 证券	20221 21400 00563 6	碧水源	2022 年 12 月 14 日	2,121, 120.0 0	432,0 00.00	14	3.50	2,802. 99	-	-
华泰 证券	20221 21400 00563 7	泰格 医药	2022 年 12 月 14 日	1,445, 700.0 0	15,80 0.00	14	3.50	1,910. 45	-	-
华泰 证券	20221 21400 00563 8	聚光 科技	2022 年 12 月 14 日	2,136, 453.0 0	64,10 0.00	14	3.50	2,823. 25	-	-
华泰 证券	20221 21400 00563 9	中金 环境	2022 年 12 月 14 日	2,530, 000.0 0	1,000, 000.0 0	14	3.50	3,343. 31	-	-
华泰 证券	20221 21400 00564 0	节能 铁汉	2022 年 12 月 14 日	2,290, 000.0 0	1,000, 000.0 0	14	3.50	3,026. 16	-	-
华泰 证券	20221 21500 00350 0	碧水源	2022 年 12 月 15 日	747,3 88.00	151,6 00.00	14	3.50	987.6 5	-	-
华泰 证券	20221 21500 00350 2	兴源 环境	2022 年 12 月 15 日	25,81 8.00	7,800. 00	14	3.50	34.12	-	-
华泰 证券	20221 21600 00202 9	军信 股份	2022 年 12 月 16 日	17,83 1.00	1,100. 00	14	3.50	23.56	-	-
华泰 证券	20221 21600 00203 0	碧水源	2022 年 12 月 16 日	14,88 0.00	3,000. 00	14	3.50	19.66	-	-
华泰 证券	20221 21600	浩通 科技	2022 年 12	103,4 10.00	2,700. 00	14	3.50	136.6 5	-	-

	002033		月16日							
华泰证券	202212190021928	碧水源	2022年12月19日	4,726,080.00	984,600.00	15	3.50	5,353.17	4,657,158.00	5,513.76
华泰证券	202212200001142	卓胜微	2022年12月20日	2,206,368.00	18,800.00	28	3.50	2,290.86	2,148,840.00	2,359.59
华泰证券	202212200001144	天合光能	2022年12月20日	2,361,990.00	43,000.00	14	3.50	2,452.44	2,741,680.00	2,526.02
华泰证券	2022122100002397	军信股份	2022年12月21日	17,292.00	1,100.00	14	3.50	16.32	17,402.00	16.81
华泰证券	2022122200000947	军信股份	2022年12月22日	1,318,040.00	83,000.00	14	3.50	1,119.69	1,313,060.00	1,153.29
华泰证券	2022122200000953	仕净科技	2022年12月22日	454,400.00	12,800.00	14	3.50	386.02	533,888.00	397.60
华泰证券	2022122200000954	浩通科技	2022年12月22日	71,193.00	1,900.00	28	3.50	60.48	79,800.00	62.29
华泰证券	2022122200000957	浩通科技	2022年12月22日	194,844.00	5,200.00	14	3.50	165.52	218,400.00	170.49
华泰证券	2022122200000959	节能铁汉	2022年12月22日	279,054.00	125,700.00	14	3.50	237.06	285,339.00	244.17
华泰证券	2022122200000962	中芯国际	2022年12月22日	217,671.00	5,300.00	28	3.50	184.91	218,042.00	190.46
华泰证券	2022122300	宁德时代	2022年12月	1,793,160.00	4,500.00	28	3.50	1,354.06	1,770,390.00	1,394.68

	002116		月 23 日	0					0	
华泰证券	2022122800025965	浩通科技	2022 年 12 月 28 日	683,350.00	17,300.00	14	3.50	193.51	726,600.00	199.31
华泰证券	2022122800026023	仕净科技	2022 年 12 月 28 日	2,757,256.00	65,900.00	14	3.50	780.78	2,748,689.00	804.20
华泰证券	2022122800028809	碧水源	2022 年 12 月 28 日	2,039,040.00	432,000.00	14	3.50	577.40	2,043,360.00	594.72
华泰证券	2022122800028811	聚光科技	2022 年 12 月 28 日	2,198,630.00	64,100.00	14	3.50	622.59	2,172,990.00	641.27
华泰证券	2022122800028969	泰格医药	2022 年 12 月 28 日	1,623,924.00	15,800.00	14	3.50	459.85	1,655,840.00	473.64
华泰证券	2022122900000342	节能铁汉	2022 年 12 月 29 日	2,240,000.00	1,000,000.00	14	3.50	422.87	2,270,000.00	435.56
华泰证券	2022122900000344	兴源环境	2022 年 12 月 29 日	2,521,131.00	815,900.00	14	3.50	475.94	2,610,880.00	490.22
华泰证券	2022122900000348	节能铁汉	2022 年 12 月 29 日	1,168,160.00	521,500.00	14	3.50	220.53	1,183,805.00	227.14
华泰证券	2022122900000350	浩通科技	2022 年 12 月 29 日	802,800.00	20,000.00	32	3.50	151.55	840,000.00	156.10
华泰证券	2022122900000353	天源环保	2022 年 12 月 29 日	11,976.00	1,200.00	14	3.50	2.26	11,460.00	2.33
华泰证券	2022122900000356	中金环境	2022 年 12 月 29 日	2,410,000.00	1,000,000.00	14	3.50	454.96	2,430,000.00	468.61



	000354		月 29 日	0	0				0	
华泰证券	202212290000356	中金环境	2022年12月29日	327,760.00	136,000.00	14	3.50	61.87	330,480.00	63.73
华泰证券	202212290000361	艾布鲁	2022年12月29日	41,822.00	2,200.00	14	3.50	7.90	41,800.00	8.13
华泰证券	2022122900010337	碧水源	2022年12月29日	709,488.00	151,600.00	14	3.50	133.94	717,068.00	137.96
华泰证券	2022122900010339	兴源环境	2022年12月29日	24,102.00	7,800.00	14	3.50	4.55	24,960.00	4.69
华泰证券	202212300000423	兴源环境	2022年12月30日	6,400.00	2,000.00	14	3.50	0.60	6,400.00	0.62
华泰证券	2022123000013441	浩通科技	2022年12月30日	113,400.00	2,700.00	14	3.50	10.70	113,400.00	11.03
华泰证券	2022123000014143	碧水源	2022年12月30日	14,190.00	3,000.00	14	3.50	1.34	14,190.00	1.38
兴业证券	2022091400000831	阳光电源	2022年9月14日	199,886.00	1,700.00	14	3.50	264.14	-	-

## 上年度可比期间 2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：）	出借期限（单位：）	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

证券										
----	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	58,800,000.00	2.62%	-	-

注：华泰证券投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

##### 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 11 月 26 日 (基金合同生效日) 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
农业银行	2,281,489.87	24,502.48	154,774,408.04	197,214.82

注：本基金由基金托管人中国农业银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

##### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
华泰联合	110085	通 22 转债	配债	16,240	1,624,000.00
华泰联合	301195	北路智控	网下申购	3,300	234,861.00
华泰联合	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64
华泰联合	301316	慧博云通	网下申购	3,584	27,238.40

上年度可比期间 2021 年 11 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
华泰联合	-	-	-	-	-

##### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（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	新股锁定期	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301195	北路智控	2022年7月25日	6个月	新股锁定期	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
301223	中荣股份	2022年10月13日	6个月	新股锁定期	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-
301270	汉仪股份	2022年8月19日	6个月	新股锁定期	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	新股锁定期	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301283	聚胶股份	2022年8月26日	6个月	新股锁定期	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301297	富乐德	2022年12月23日	6个月	新股锁定期	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股锁定期	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股锁定期	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301318	维海德	2022年8月3日	6个月	新股锁定期	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-
301319	唯特偶	2022	6个月	新股锁	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-

		年 9 月 22 日		定期						
301363	美好医疗	2022 年 9 月 28 日	6 个月	新股锁定期	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301366	一博科技	2022 年 9 月 19 日	6 个月	新股锁定期	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-
301367	怡和嘉业	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股锁定期	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94	-
301379	天山电子	2022 年 10 月 19 日	6 个月	新股锁定期	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87	-
301388	欣灵电气	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股锁定期	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301391	卡莱特	2022 年 11 月 24 日	6 个月	新股锁定期	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	-
688084	晶品特装	2022 年 12 月 1 日	6 个月	新股锁定期	60.98	74.73	1,875	114,337.50	140,118.75	-

#### 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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

注 1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

**7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
1	600008	首创环保	2023年1月3日 -2023年1月13日	2.83	3,716,500.00	10,517,695.00
2	300203	聚光科技	2023年1月5日 -2023年1月12日	33.90	305,600.00	10,359,840.00
3	600481	双良节能	2023年1月11日 -2023年1月12日	12.94	789,200.00	10,212,248.00
4	300070	碧水源	2023年1月3日 -2023年1月13日	4.73	2,137,000.00	10,108,010.00
5	603588	高能环境	2023年1月5日 -2023年1月11日	9.84	772,700.00	7,603,368.00
6	600438	通威股份	2023年1月5日 -2023年1月19日	38.58	158,800.00	6,126,504.00
7	688599	天合光能	2023年1月3日	63.76	83,300.00	5,311,208.00
8	601200	上海环境	2023年1月11日	8.93	560,900.00	5,008,837.00
9	601669	中国电建	2023年1月5日 -2023年1月12日	7.08	600,000.00	4,248,000.00
10	002549	凯美特气	2023年1月5日	15.11	264,200.00	3,992,062.00

			-2023 年 1 月 12 日			
11	300197	节能铁汉	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 12 日	2.27	1,662,100.00	3,772,967.00
12	000625	长安汽车	2023 年 1 月 11 日	12.31	292,000.00	3,594,520.00
13	600217	中再资环	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	4.92	703,300.00	3,460,236.00
14	301030	仕净科技	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 11 日	41.71	78,700.00	3,282,577.00
15	002034	旺能环境	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 11 日	18.04	170,200.00	3,070,408.00
16	000826	启迪环境	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	3.53	845,100.00	2,983,203.00
17	300266	兴源环境	2023 年 1 月 12 日 -2023 年 1 月 13 日	3.20	926,500.00	2,964,800.00
18	603659	璞泰来	2023 年 1 月 6 日	51.89	53,300.00	2,765,737.00
19	300145	中金环境	2023 年 1 月 12 日	2.43	1,136,000.00	2,760,480.00
20	600703	三安光电	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 6 日	17.16	157,400.00	2,700,984.00
21	601199	江南水务	2023 年 1 月 6 日 -2023 年 1 月 12 日	6.70	392,700.00	2,631,090.00
22	600150	中国船舶	2023 年 1 月 3 日	22.28	103,000.00	2,294,840.00
23	600196	复星医药	2023 年 1 月 11 日	35.24	65,000.00	2,290,600.00

24	601868	中国能建	2023 年 1 月 3 日	2.29	996,100.00	2,281,069.00
25	300782	卓胜微	2023 年 1 月 17 日	114.30	18,800.00	2,148,840.00
26	000551	创元科技	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	8.57	238,600.00	2,044,802.00
27	301026	浩通科技	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 30 日	42.00	47,100.00	1,978,200.00
28	601800	中国交建	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 10 日	8.05	227,400.00	1,830,570.00
29	300750	宁德时代	2023 年 1 月 20 日	393.42	4,500.00	1,770,390.00
30	300347	泰格医药	2023 年 1 月 11 日	104.80	15,800.00	1,655,840.00
31	688396	华润微	2023 年 1 月 3 日	52.65	31,000.00	1,632,150.00
32	301109	军信股份	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 11 日	15.82	102,000.00	1,613,640.00
33	002415	海康威视	2023 年 1 月 3 日	34.68	42,100.00	1,460,028.00
34	000301	东方盛虹	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 5 日	13.04	109,500.00	1,427,880.00
35	688012	中微公司	2023 年 1 月 6 日	98.01	14,300.00	1,401,543.00
36	600475	华光环能	2023 年 1 月 4 日 -2023 年 1 月 9 日	8.79	121,400.00	1,067,106.00
37	301127	天源环保	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	9.55	105,300.00	1,005,615.00
38	601865	福莱特	2023 年 1 月 10 日	33.31	30,000.00	999,300.00

39	300919	中伟股份	2023 年 1 月 3 日	65.61	15,000.00	984,150.00
40	300072	海新能科	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	4.36	201,400.00	878,104.00
41	601186	中国铁建	2023 年 1 月 3 日	7.73	109,800.00	848,754.00
42	600025	华能水电	2023 年 1 月 4 日	6.60	93,000.00	613,800.00
43	301259	艾布鲁	2023 年 1 月 11 日 -2023 年 1 月 12 日	19.00	30,300.00	575,700.00
44	603568	伟明环保	2023 年 1 月 12 日	18.53	20,400.00	378,012.00
45	688981	中芯国际	2023 年 1 月 19 日	41.14	5,300.00	218,042.00
46	601388	怡球资源	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 11 日	3.34	30,000.00	100,200.00
47	000598	兴蓉环境	2023 年 1 月 11 日	4.89	20,000.00	97,800.00
合计	-	-	-	-	18,602,600.00	141,071,749.00

### 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

本基金是被动式指数基金，紧密跟踪中证长江保护主题指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险、市场制度以及交易规则不同等境外证券市场投资所面临的特有风险。本基金采用完全复制法，跟踪中证长江保护主题指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理



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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于本年度末，本基金无债券投资(上年度末：同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本年度末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.03%。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

#### 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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,281,489.87	-	-	-	2,281,489.87
结算备付金	8,478,405.70	-	-	-	8,478,405.70
存出保证金	43,335.90	-	-	1,723,272.60	1,766,608.50
交易性金融资产	-	-	-	1,664,453,10 2.05	1,664,453,10 2.05
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	726,085.93	726,085.93
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	54,182.34	54,182.34
资产总计	10,803,231.4 7	-	-	1,666,956,64 2.92	1,677,759,87 4.39
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-

债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	217,042.69	217,042.69
应付托管费	-	-	-	72,347.58	72,347.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7,201.87	7,201.87
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	618,921.43	618,921.43
负债总计	-	-	-	915,513.57	915,513.57
利率敏感度缺口	10,803,231.47	-	-	1,666,041,129.35	1,676,844,360.82
上年度末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	154,774,408.04	-	-	-	154,774,408.04
结算备付金	111,656,278.72	-	-	-	111,656,278.72
存出保证金	363,743.71	-	-	-	363,743.71
交易性金融资产	-	-	-	2,190,453,016.16	2,190,453,016.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	319,258.81	319,258.81
资产总计	266,794,430.47	-	-	2,190,772,274.97	2,457,566,705.44
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	70,832,470.76	70,832,470.76
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	302,090.24	302,090.24
应付托管费	-	-	-	100,696.74	100,696.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	217,578.43	217,578.43
负债总计	-	-	-	71,452,836.17	71,452,836.17
利率敏感度缺口	266,794,430.47	-	-	2,119,319,438.80	2,386,113,869.27

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本年度末，本基金未持有交易性债券投资(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(上年度末：同)。

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	127,945,46 0.53	-	-	-	127,945,46 0.53
资产合计	-	127,945,46 0.53	-	-	-	127,945,46 0.53
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	127,945,46 0.53	-	-	-	127,945,46 0.53

项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	297,295,42 9.93	-	-	-	297,295,42 9.93
资产合计	-	297,295,42 9.93	-	-	-	297,295,42 9.93
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	297,295,42 9.93	-	-	-	297,295,42 9.93

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	6,397,273.03	14,864,771.50
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-6,397,273.03	-14,864,771.50

#### 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交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪中证长江保护主题指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于中证长江保护主题指数成份股和备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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	1,664,453,102.05	99.26	2,190,453,016.16	91.80
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	1,664,453,102.05	99.26	2,190,453,016.16	91.80

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注 7.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变
----	----------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
	1.组合自身基准上升 5%	83,794,066.96	26,208,322.50
	2.组合自身基准下降 5%	-83,794,066.96	-26,208,322.50

#### 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	1,664,032,268.53	2,190,453,016.16
第二层次	-	-
第三层次	420,833.52	-
合计	1,664,453,102.05	2,190,453,016.16

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		合计
	交易性金融资产		
	债券投资	股票	



期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	511,239.23	511,239.23
转出第三层次	-	180,791.20	180,791.20
当期利得或损失总额	-	90,385.49	90,385.49
其中：计入损益的利得或损失	-	90,385.49	90,385.49
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	420,833.52	420,833.52
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	-	45,918.97	45,918.97
项目	上年度可比同期 2021 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-

于本年度末,本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于本年度,本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	420,833.52	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2319~2.4756	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本年度末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于本年度，本基金申购基金份额的对价总额为 5,458,827.18 元(上年度：无)，其中包括以股票支付的申购款 2,327,574.00 元和以现金支付的申购款 3,131,253.18 元(上年度：无)。

##### (2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,664,453,102.05	99.21
	其中：股票	1,664,453,102.05	99.21
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	10,759,895.57	0.64
8	其他资产	2,546,876.77	0.15
9	合计	1,677,759,874.39	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下表中的合计项中不含可退替代款估值增值；

2、通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 141,071,749.00 元，占基金资产净值的比例为 8.41%；

3、本基金本报告期末通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 127,945,460.53 元，占基金资产净值比例 7.63%。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	712,231,686.48	42.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	188,912,240.32	11.27
E	建筑业	117,031,987.77	6.98
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,954,986.00	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,034,497.60	1.49
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	116,907,501.60	6.97
N	水利、环境和公共设施管理业	336,545,989.09	20.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	26,157,366.95	1.56
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	8,163,182.10	0.49
	合计	1,535,939,437.91	91.60

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	445,030.43	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	99,204.38	0.01
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	23,968.80	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	568,203.61	0.03

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	12,610,971.48	0.75
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费	-	-
必需消费品	-	-
医疗保健	31,461,228.45	1.88
金融	-	-
科技	14,937,515.52	0.89
通讯	-	-
公用事业	68,935,745.08	4.11
房地产	-	-
政府	-	-
合计	127,945,460.53	7.63

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

### 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	300012	华测检测	4,008,392	89,387,141.6 0	5.33
2	300750	宁德时代	132,700	52,206,834.0 0	3.11
3	600900	长江电力	2,416,200	50,740,200.0 0	3.03
4	600008	首创环保	14,836,600	41,987,578.0 0	2.50
5	300203	聚光科技	1,219,500	41,341,050.0 0	2.47
6	600481	双良节能	3,150,800	40,771,352.0 0	2.43
7	300070	碧水源	8,546,028	40,422,712.4 4	2.41
8	00257	光大环境	12,415,000	38,703,915.2 0	2.31
9	002415	海康威视	1,106,700	38,380,356.0 0	2.29
10	600519	贵州茅台	21,600	37,303,200.0 0	2.22
11	600276	恒瑞医药	964,540	37,163,726.2 0	2.22
12	300274	阳光电源	318,700	35,630,660.0 0	2.12
13	601668	中国建筑	6,427,200	34,899,696.0 0	2.08
14	603568	伟明环保	1,712,164	31,726,398.9 2	1.89
15	603588	高能环境	3,084,376	30,350,259.8 4	1.81
16	00371	北控水务集团	16,922,000	30,231,829.8 8	1.80
17	000598	兴蓉环境	6,035,700	29,514,573.0 0	1.76
18	000792	盐湖股份	1,274,700	28,922,943.0 0	1.72
19	002266	浙富控股	7,235,560	28,291,039.6	1.69

				0	
20	02269	药明生物	525,000	28,067,659.9 9	1.67
21	300015	爱尔眼科	841,885	26,157,366.9 5	1.56
22	600406	国电南瑞	1,026,004	25,034,497.6 0	1.49
23	600438	通威股份	633,779	24,451,193.8 2	1.46
24	300072	海新能科	5,540,700	24,157,452.0 0	1.44
25	688599	天合光能	332,491	21,199,626.1 6	1.26
26	603259	药明康德	255,400	20,687,400.0 0	1.23
27	601200	上海环境	2,267,534	20,249,078.6 2	1.21
28	000967	盈峰环境	4,284,200	19,450,268.0 0	1.16
29	688981	中芯国际	459,250	18,893,545.0 0	1.13
30	601390	中国中铁	3,149,100	17,508,996.0 0	1.04
31	601985	中国核电	2,889,200	17,335,200.0 0	1.03
32	300122	智飞生物	187,700	16,485,691.0 0	0.98
33	601669	中国电建	2,321,400	16,435,512.0 0	0.98
34	002549	凯美特气	1,075,800	16,255,338.0 0	0.97
35	600104	上汽集团	1,096,494	15,800,478.5 4	0.94
36	300197	节能铁汉	6,656,400	15,110,028.0 0	0.90
37	300142	沃森生物	375,800	15,103,402.0 0	0.90
38	02382	舜宇光学科技	180,100	14,937,515.5 2	0.89
39	600905	三峡能源	2,631,900	14,870,235.0 0	0.89
40	601388	怡球资源	4,449,500	14,861,330.0 0	0.89

41	000625	长安汽车	1,165,620	14,348,782.2 0	0.86
42	600217	中再资环	2,806,801	13,809,460.9 2	0.82
43	301030	仕净科技	314,400	13,113,624.0 0	0.78
44	002034	旺能环境	723,400	13,050,136.0 0	0.78
45	002717	岭南股份	4,540,600	12,940,710.0 0	0.77
46	603501	韦尔股份	166,650	12,847,048.5 0	0.77
47	00968	信义光能	1,634,000	12,610,971.4 8	0.75
48	600150	中国船舶	548,400	12,218,352.0 0	0.73
49	000858	五粮液	66,600	12,033,954.0 0	0.72
50	000826	启迪环境	3,373,420	11,908,172.6 0	0.71
51	300266	兴源环境	3,702,700	11,848,640.0 0	0.71
52	600019	宝钢股份	2,090,000	11,683,100.0 0	0.70
53	300536	农尚环境	790,427	11,469,095.7 7	0.68
54	603659	璞泰来	213,200	11,062,948.0 0	0.66
55	300145	中金环境	4,535,500	11,021,265.0 0	0.66
56	601827	三峰环境	1,696,100	10,905,923.0 0	0.65
57	601186	中国铁建	1,410,400	10,902,392.0 0	0.65
58	603806	福斯特	163,220	10,844,336.8 0	0.65
59	601199	江南水务	1,575,200	10,553,840.0 0	0.63
60	600703	三安光电	585,300	10,043,748.0 0	0.60
61	688012	中微公司	101,229	9,921,454.29	0.59
62	600196	复星医药	274,400	9,669,856.00	0.58
63	000803	山高环能	830,000	9,437,100.00	0.56

64	300631	久吾高科	330,500	9,204,425.00	0.55
65	000538	云南白药	168,500	9,159,660.00	0.55
66	601868	中国能建	3,976,200	9,105,498.00	0.54
67	601330	绿色动力	1,332,700	9,022,379.00	0.54
68	002479	富春环保	2,039,700	8,852,298.00	0.53
69	002493	荣盛石化	712,836	8,767,882.80	0.52
70	601800	中国交建	1,080,300	8,696,415.00	0.52
71	300782	卓胜微	75,140	8,588,502.00	0.51
72	603359	东珠生态	751,320	8,414,784.00	0.50
73	600475	华光环能	953,800	8,383,902.00	0.50
74	000551	创元科技	952,530	8,163,182.10	0.49
75	301026	浩通科技	190,900	8,017,800.00	0.48
76	001267	汇绿生态	1,044,900	8,014,383.00	0.48
77	300172	中电环保	1,595,700	7,037,037.00	0.42
78	300347	泰格医药	65,200	6,832,960.00	0.41
79	300198	纳川股份	2,432,400	6,567,480.00	0.39
80	301109	军信股份	414,321	6,554,558.22	0.39
81	688396	华润微	123,885	6,522,545.25	0.39
82	300692	中环环保	999,200	6,374,896.00	0.38
83	603324	盛剑环境	168,500	5,909,295.00	0.35
84	600283	钱江水利	475,700	5,841,596.00	0.35
85	002996	顺博合金	443,600	5,780,108.00	0.34
86	000301	东方盛虹	437,400	5,703,696.00	0.34
87	000568	泸州老窖	25,300	5,674,284.00	0.34
88	603759	海天股份	622,192	5,574,840.32	0.33
89	601865	福莱特	156,100	5,199,691.00	0.31
90	300187	永清环保	869,900	4,967,129.00	0.30
91	600018	上港集团	927,900	4,954,986.00	0.30
92	603177	德创环保	279,600	4,599,420.00	0.27
93	000708	中信特钢	236,900	4,065,204.00	0.24
94	300919	中伟股份	61,600	4,041,576.00	0.24
95	301127	天源环保	422,767	4,037,424.85	0.24
96	300800	力合科技	321,200	3,738,768.00	0.22
97	600025	华能水电	551,800	3,641,880.00	0.22
98	03692	翰森制药	256,000	3,393,568.46	0.20
99	001230	劲旅环境	112,600	2,903,954.00	0.17
100	301259	艾布鲁	121,300	2,304,700.00	0.14

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	---------	-----------



					(%)
1	688084	晶品特装	1,875	140,118.75	0.01
2	301238	瑞泰新材	3,497	78,647.53	0.00
3	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
4	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
5	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
6	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
7	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
8	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
9	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00
10	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
11	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
12	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
13	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
14	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
15	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
16	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
17	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
18	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
19	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
20	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 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	600481	双良节能	50,229,629.79	2.11
2	000792	盐湖股份	39,976,358.00	1.68
3	00586	海螺创业	21,596,039.41	0.91
4	300750	宁德时代	19,887,593.50	0.83
5	002549	凯美特气	18,367,410.73	0.77
6	600461	洪城环境	15,855,320.40	0.66
7	000803	山高环能	14,785,456.40	0.62
8	601199	江南水务	14,232,177.75	0.60
9	300012	华测检测	13,769,533.85	0.58
10	00257	光大环境	13,704,844.70	0.57
11	601158	重庆水务	11,679,658.99	0.49
12	600900	长江电力	11,642,004.69	0.49
13	688012	中微公司	11,340,719.47	0.48
14	300070	碧水源	9,902,192.87	0.41

15	600475	华光环能	9,815,932.30	0.41
16	02269	药明生物	9,392,508.43	0.39
17	000551	创元科技	9,363,221.80	0.39
18	00371	北控水务集团	9,358,604.24	0.39
19	601985	中国核电	9,149,197.00	0.38
20	600283	钱江水利	8,954,204.76	0.38

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	00586	海螺创业	62,160,672.83	2.61
2	00587	海螺环保	29,708,629.38	1.25
3	600900	长江电力	29,435,607.99	1.23
4	300012	华测检测	25,545,595.33	1.07
5	000925	众合科技	15,509,801.36	0.65
6	600461	洪城环境	13,521,303.00	0.57
7	300664	鹏鹞环保	11,214,164.50	0.47
8	601158	重庆水务	10,876,533.00	0.46
9	300388	节能国祯	10,798,780.48	0.45
10	300274	阳光电源	9,569,718.05	0.40
11	300190	维尔利	9,443,196.00	0.40
12	600475	华光环能	8,698,079.01	0.36
13	600292	远达环保	8,597,360.76	0.36
14	600741	华域汽车	8,210,397.64	0.34
15	300692	中环环保	8,003,645.00	0.34
16	01801	信达生物	7,960,707.54	0.33
17	601668	中国建筑	7,896,481.00	0.33
18	00257	光大环境	7,657,494.98	0.32
19	688012	中微公司	7,245,376.52	0.30
20	600526	菲达环保	7,204,568.70	0.30

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	654,504,143.55
卖出股票收入（成交）总额	513,385,537.24

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

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

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

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

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,766,608.50
2	应收清算款	726,085.93
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	54,182.34
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,546,876.77

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600008	首创环保	10,517,695.00	0.63	转融通融出
2	300203	聚光科技	10,359,840.00	0.62	转融通融出
3	600481	双良节能	10,212,248.00	0.61	转融通融出
4	300070	碧水源	10,108,010.00	0.60	转融通融出
5	300750	宁德时代	1,770,390.00	0.11	转融通融出
6	002415	海康威视	1,460,028.00	0.09	转融通融出

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的	占基金资产净值	流通受限情况说
----	------	------	---------	---------	---------

			公允价值（元）	比例（%）	明
1	688084	晶品特装	140,118.75	0.01	新股锁定期
2	301095	广立微	64,002.60	0.00	新股锁定期
3	301367	怡和嘉业	39,198.94	0.00	新股锁定期

## § 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

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
690	3,247,503.61	2,233,112,088.00	99.66%	7,665,400.00	0.34%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	长江三峡投资管理有限公司	1,000,000,000.00	44.63%
2	长电投资管理有限责任公司	400,000,000.00	17.85%
3	长江生态环保集团有限公司	400,000,000.00	17.85%
4	中银国际证券-中国银行-中银证券中国红-汇中 27 号集合资产管理计划	105,000,000.00	4.69%
5	农银汇理资产-农业银行-农银汇理资产-复合策略 1 号集合资产管理计划	100,018,888.00	4.46%
6	华泰证券股份有限公司	58,800,000.00	2.62%
7	中国人民财产保险股份有限公司-传统-收益组合	50,018,888.00	2.23%
8	中金公司-建设银行-中金铭杉 1 号集合资产管理计划	41,846,727.00	1.87%
9	创金合信基金-中国银行-创金合信鼎泰 33 号集合资产管理计划	25,016,527.00	1.12%
10	创金合信基金-中国银行-创金合信鼎泰 70 号集合资产管理计划	20,003,777.00	0.89%

注：持有人名称与注册登记机构持有人名册保持一致。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员（包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理）均未持有本基金份额。

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

#### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
龚涛	公募基金	50~100
	私募资产管理计划	0
	合计	50~100

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年11月26日)基金份额总额	2,370,777,488.00
本报告期期初基金份额总额	2,370,777,488.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	136,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,240,777,488.00

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开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

2022年5月27日，周易先生任南方基金管理股份有限公司董事长（法定代表人）。

2022年3月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022年3月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

#### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务 1 年，本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 99,000.00 元。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 1 月 29 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	个别基金内部控制不完善
管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	基金管理人已及时按要求改正并报告
其他	/

##### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

#### 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	
平安证券	2	598,518,565.29	51.76%	59,853.61	51.76%	-
华泰证券	4	448,400,881.18	38.77%	44,840.37	38.77%	-
银河证券	2	100,510,540.33	8.69%	10,051.76	8.69%	-
申万宏源	2	9,004,172.26	0.78%	900.44	0.78%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

招商证券	1	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

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

A：选择标准

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

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

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

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

招商证券

华泰证券

退租交易单元：

华泰证券

### 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
平安证券	813,537.23	7.04%	-	-	-	-
华泰证券	4,606,199.47	39.86%	-	-	-	-
银河证券	318,687.11	2.76%	-	-	-	-
申万宏源	5,816,268.77	50.34%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-



招商证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

## 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	南方基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-05
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-27
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-12
5	南方基金管理股份有限公司关于调整旗下基金大额申购等业务安排的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-27
6	南方基金管理股份有限公司关于董事长变更的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-28
7	南方基金管理股份有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市ETF实施申赎业务多码合一的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-18
8	南方基金关于旗下部分基金增加平安证券为申购赎回代理券商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-08
9	南方基金关于旗下部分基金增加上海证券为申购赎回代理券商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-20
10	关于注意防范冒用南方基金及子公司、南方基金投研人员名义从事诈骗活动的风险提示	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-20
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-27
12	关于南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-08-25
13	南方基金关于旗下部分基金增加广发证券为申购赎回代理券商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会	2022-09-14

		基金电子披露网站	
14	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-30
15	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分上海证券交易所 ETF 暂停申购、赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-02
16	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-16
17	关于注意防范冒用南方基金及子公司、南方基金投研人员名义从事诈骗活动的风险提示	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-16

## § 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

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	20220101-20221231	1,000,000,000.00	-	-	1,000,000,000.00	44.63%

#### 产品特有风险

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

注：申购份额包含份额折算。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

- 3、《南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告》原文。

### 13.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>