

# 深证成份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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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.....	15
§7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告.....	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
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.....	65

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.....	65
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.....	65
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.....	66
8.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	66
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
8.12	投资组合报告附注.....	66
§9	基金份额持有人信息.....	67
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
9.2	期末上市基金前十名持有人.....	67
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
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.....	68
§10	开放式基金份额变动.....	68
§11	重大事件揭示.....	68
11.1	基金份额持有人大会决议.....	68
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.....	68
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
11.4	基金投资策略的改变.....	69
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
11.8	其他重大事件.....	71
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	72
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.....	72
12.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	73
§13	备查文件目录.....	73
13.1	备查文件目录.....	73
13.2	存放地点.....	73
13.3	查阅方式.....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方深证成份 ETF
场内简称	深成 ETF
基金主代码	159903
交易代码	159903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 4 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	190,154,507.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 2 月 2 日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

信息披露负责人	姓名	常克川	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518017	100140
法定代表人		周易	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<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	2020 年
本期已实现收益	380,273.79	67,729,625.92	77,023,264.28
本期利润	-74,088,269.19	20,287,330.13	150,480,372.68
加权平均基金份额本期利润	-0.4153	0.1043	0.5010
本期加权平均净值利润率	-29.70%	6.22%	37.31%
本期基金份额净值增长率	-25.29%	5.36%	42.42%
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	-12,332,665.46	64,052,859.93	65,134,758.24
期末可供分配基金份额利润	-0.0649	0.3720	0.2842
期末基金资产净值	245,377,401.01	297,368,126.22	375,700,225.01
期末基金份额净值	1.2904	1.7273	1.6395
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	-4.79%	27.45%	20.97%

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。

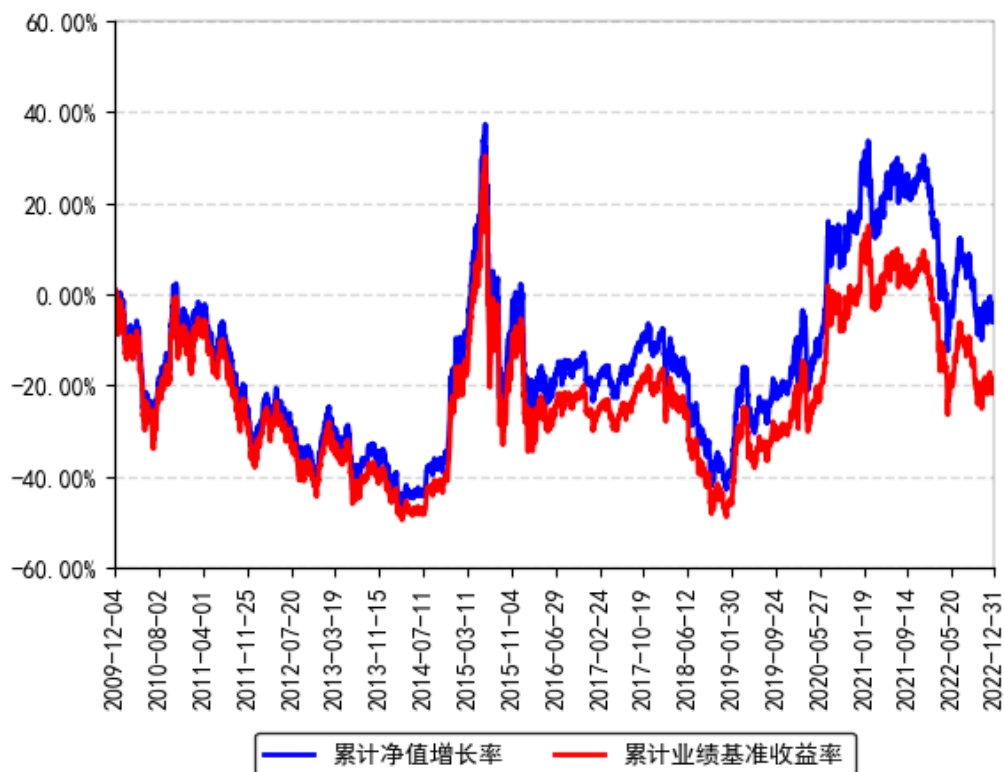
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	2.10%	1.29%	2.20%	1.29%	-0.10%	0.00%
过去六个月	-14.42%	1.20%	-14.58%	1.20%	0.16%	0.00%
过去一年	-25.29%	1.46%	-25.85%	1.46%	0.56%	0.00%
过去三年	12.09%	1.48%	5.61%	1.47%	6.48%	0.01%
过去五年	7.74%	1.48%	-0.22%	1.48%	7.96%	0.00%
自基金合同生效起至今	-4.79%	1.57%	-20.66%	1.58%	15.87%	-0.01%

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

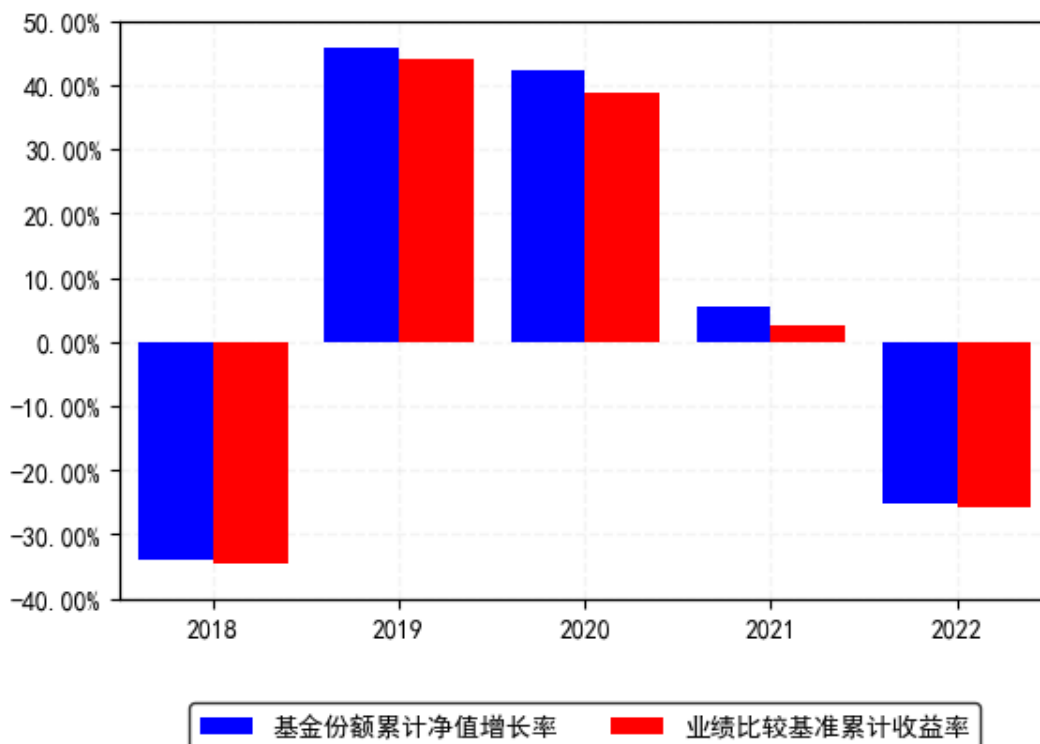
南方深证成份ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



南方深证成份ETF每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

					方上证 380ETF 联接基金经理 2020 年 12 月 1 日至今，任高铁基金基金经理 2022 年 3 月 3 日至今，任南方上海金 ETF 基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

#### 4.1.3 基金经理薪酬机制

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，两两组合间单日、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

深证成指报告期内下跌25.85%。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

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

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

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

（4）新股上市初期涨幅较大的影响。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2904 元，报告期内，份额净值增长率为-25.29%，同期业绩基准增长率为-25.85%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

后疫情时代，经济企稳回升和企业盈利复苏，美联储加息接近尾声，国内流动性充裕，兼之 A 股市场总体估值位于历史相对低位，2023 年市场展望更为积极。

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方案实现落地推进。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程，有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内,本基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

### § 6 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 27654 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	深证成份交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人

<p>审计意见</p>	<p>(一)我们审计的内容 我们审计了深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南方深证成份 ETF 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 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了南方深证成份 ETF 基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<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,我们独立于南方深证成份 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>-</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>南方深证成份 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深证成份 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深证成份 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深证成份 ETF 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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</p>



	<p>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，就可能对南方深证成份 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深证成份 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：深证成份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	上年度末 2021 年 12 月
----	-----	--------------------	------------------

		日	31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	177,852.98	621,421.62
结算备付金		4,026.43	6,027.14
存出保证金		1,286.30	2,253.15
交易性金融资产	7.4.7.2	245,435,378.82	297,165,242.29
其中：股票投资		245,435,378.82	297,165,242.29
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	49.51
资产总计		245,618,544.53	297,794,993.71
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		-	3.70
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		103,058.42	127,353.42
应付托管费		20,611.70	25,470.68
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	7.4.7.6	117,473.40	274,039.69

负债合计		241,143.52	426,867.49
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	257,710,066.47	233,315,266.29
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-12,332,665.46	64,052,859.93
净资产合计		245,377,401.01	297,368,126.22
负债和净资产总计		245,618,544.53	297,794,993.71

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2904 元，基金份额总额 190,154,507.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		-72,286,787.41	22,618,963.96
1.利息收入		1,895.81	2,701.16
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,895.81	2,555.43
债券利息收入		-	145.73
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		2,179,070.38	70,059,894.64
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,123,891.03	66,168,043.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	69,315.15	264,662.45
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	-	-
股利收益	7.4.7.14	3,233,646.26	3,627,188.27
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	-74,468,542.98	-47,442,295.79
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	789.38	-1,336.05
减：二、营业总支出		1,801,481.78	2,331,633.83
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,246,737.99	1,632,772.17
2.托管费	7.4.10.2.2	249,347.62	326,554.38
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		0.17	0.46
8.其他费用	7.4.7.17	305,396.00	372,306.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-74,088,269.19	20,287,330.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-74,088,269.19	20,287,330.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-74,088,269.19	20,287,330.13

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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）	233,315,266.29	-	64,052,859.93	297,368,126.22
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）	233,315,266.29	-	64,052,859.93	297,368,126.22
三、本期增减变	24,394,800.18	-	-76,385,525.39	-51,990,725.21

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	-74,088,269.19	-74,088,269.19
（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）	24,394,800.18	-	-2,297,256.20	22,097,543.98
其中：1.基金申购款	77,250,200.51	-	1,645,697.52	78,895,898.03
2.基金赎回款	-52,855,400.33	-	-3,942,953.72	-56,798,354.05
（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）	257,710,066.47	-	-12,332,665.46	245,377,401.01
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）	310,565,466.77	-	65,134,758.24	375,700,225.01
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）	310,565,466.77	-	65,134,758.24	375,700,225.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-77,250,200.48	-	-1,081,898.31	-78,332,098.79
（一）、综合收益总额	-	-	20,287,330.13	20,287,330.13
（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）	-77,250,200.48	-	-21,369,228.44	-98,619,428.92

号填列)				
其中: 1.基金申购款	93,513,400.56	-	20,810,340.83	114,323,741.39
2.基金赎回款	-170,763,601.04	-	-42,179,569.27	-212,943,170.31
(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)	233,315,266.29	-	64,052,859.93	297,368,126.22

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

深证成份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[2009]1066号《关于核准深证成份交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司,已于2018年1月4日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证成份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4,127,252,482.00元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第263号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2009年12月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,127,538,537.00份基金份额,其中通过代销机构网上现金及直销机构网下现金认购部分的认购资金利息折合286,055.00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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司确定2010年1月13日为本基金的基金份额折算日。当日深证成份指数收盘值为

13,016.557 点，本基金的基金资产净值为 3,964,290,323.04 元，折算前基金份额总额为 4,127,538,537.00 份，折算前基金份额净值为 0.960 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.73786718，折算后基金份额总额为 3,045,554,507.00 份，折算后基金份额净值为 1.302 元。本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司已根据上述折算比例，对所有基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2010 年 1 月 15 日完成了变更登记。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2010]38 号审核同意，本基金于 2010 年 2 月 2 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证成份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深证成份指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股以及存托凭证，该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%；本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为深证成份指数。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF，于 2009 年 12 月 9 日募集成立了南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“南方深成 ETF 联接基金”)。南方深成 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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》、《深证成份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 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (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商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量：

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

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资，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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

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 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下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》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 621,421.62 元、6,027.14 元、2,253.15 元和 49.51 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、存出保证金和其他资产-应收利息，金额分别为 621,467.43 元、6,029.84 元、2,254.15 元和 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资产为交易性金融资产，金额为 297,165,242.29 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 297,165,242.29 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、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 3.70 元、127,353.42 元、25,470.68 元、4,039.69 元和 105,000.00 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、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 3.70 元、127,353.42 元、25,470.68 元、4,039.69 元和 105,000.00 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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改

增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(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	177,852.98	621,421.62
等于：本金	177,828.19	621,421.62
加：应计利息	24.79	-
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	177,852.98	621,421.62

#### 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	259,112,506. 22	-	245,435,378. 82	-13,677,127.4 0
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	259,112,506. 22	-	245,435,378. 82	-13,677,127.4 0
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	236,373,826. 71	-	297,165,242. 29	60,791,415.5 8
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	236,373,826. 71	-	297,165,242. 29	60,791,415.5 8

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**

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

**7.4.7.4 买入返售金融资产****7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 其他资产**

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	-	49.51
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	49.51

**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	1,963.89	4,039.69
其中：交易所市场	1,963.89	4,039.69
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应退退补款	509.51	-
预提费用	45,000.00	165,000.00
应付指数使用费	70,000.00	105,000.00
可退替代款	-	-
其他	-	-
合计	117,473.40	274,039.69

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	172,154,507.00	233,315,266.29
本期申购	57,000,000.00	77,250,200.51
本期赎回（以“-”号填列）	-39,000,000.00	-52,855,400.33
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	190,154,507.00	257,710,066.47

#### 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	129,857,959.15	-65,805,099.22	64,052,859.93
本期利润	380,273.79	-74,468,542.98	-74,088,269.19
本期基金份额交易产生的变动数	13,932,996.06	-16,230,252.26	-2,297,256.20
其中：基金申购款	43,855,198.97	-42,209,501.45	1,645,697.52
基金赎回款	-29,922,202.91	25,979,249.19	-3,942,953.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	144,171,229.00	-156,503,894.46	-12,332,665.46

#### 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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,442.97	1,951.94
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	422.12	556.90
其他	30.72	46.59
合计	1,895.81	2,555.43

#### 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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,094,919.78	11,689,724.21
股票投资收益——赎回差价收入	2,971,028.75	54,478,319.71
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	-1,123,891.03	66,168,043.92
----	---------------	---------------

#### 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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	27,443,399.77	48,798,845.47
减：卖出股票成本总额	31,500,959.54	37,109,121.26
减：交易费用	37,360.01	-
买卖股票差价收入	-4,094,919.78	11,689,724.21

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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	56,798,354.05	212,943,170.31
减：现金支付赎回款总额	23,184.05	190,983.31
减：赎回股票成本总额	53,804,141.25	158,273,867.29
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	2,971,028.75	54,478,319.71

#### 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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	63.66	-
债券投资收益——买卖债券（、 债转股及债券到期兑付）差价收 入	69,251.49	264,662.45
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	69,315.15	264,662.45

**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 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	398,232.22	1,567,129.32
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	328,900.00	1,302,300.00
减：应计利息总额	65.07	166.87
减：交易费用	15.66	-
买卖债券差价收入	69,251.49	264,662.45

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**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具其他投资收益。

#### 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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,233,646.26	3,627,188.27
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	3,233,646.26	3,627,188.27

#### 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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-74,468,542.98	-47,442,295.79
——股票投资	-74,468,542.98	-47,442,295.79
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-74,468,542.98	-47,442,295.79

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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	789.38	-1,336.05
合计	789.38	-1,336.05

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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	140,000.00	140,000.00
银行费用	396.00	426.00
交易费用	-	66,880.82
合计	305,396.00	372,306.82

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的费率计提，逐日累计，按季支付。当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 35,000 元，当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，无标的指数许可使用费的收取下限。

## 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

无。

## 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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
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
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金("南方深成 ETF 联接基金")	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 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
华泰证券	-	-	14,549,012.97	15.23%

#### 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
华泰证券	-	-	797,014.94	50.86%

#### 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	-	-	-	-
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
华泰证券	1,454.86	15.23%	-	-

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	上年度可比期间 2021 年 1 月
----	-------------------------	--------------------

	年 12 月 31 日	1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,246,737.99	1,632,772.17
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的 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	249,347.62	326,554.38

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

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

#### 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

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

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

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	517,200.00	0.27%	-	-
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	112,765,374.00	59.30%	105,964,874.00	61.55%

注：华泰证券和南方深成 ETF 联接基金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 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
工商银行	177,852.98	1,442.97	621,421.62	1,951.94

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 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	301327	华宝新能	网下申购	967	229,662.50
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	1,798	102,270.24
华泰联合	123145	药石转债	配债	190	19,000.00

上年度可比期间 2021 年 1 月 1 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	002142	宁波银行	配股	7,528	150,334.16
华泰联合	301078	孩子王	网下申购	7,551	43,569.27
华泰联合	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16
华泰联合	301033	迈普医学	网下申购	1,076	16,290.64
华泰联合	001234	泰慕士	网下申购	333	5,504.49



兴业证券	300941	创识科技	网下申购	3,989	85,005.59
------	--------	------	------	-------	-----------

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（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
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股锁定期	39.00	24.46	156	6,084.00	3,815.76	-
301327	华宝新能	2022年9月8日	6个月	新股锁定期	237.50	176.97	97	23,037.50	17,166.09	-
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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

1. 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300850	新强联	2022年12月30日	重大事项停牌	53.28	2023年1月10日	56.88	4,000	318,517.86	213,120.00	-

本基金截至 2022 年 12 月 31 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

### 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工商银行,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,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。

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

#### 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 0.10%。

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	177,852.98	-	-	-	177,852.98
结算备付金	4,026.43	-	-	-	4,026.43
存出保证金	1,286.30	-	-	-	1,286.30
交易性金融资产	-	-	-	245,435,378.82	245,435,378.82
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	183,165.71	-	-	245,435,378.82	245,618,544.53
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	103,058.42	103,058.42
应付托管费	-	-	-	20,611.70	20,611.70
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	-	-	-	117,473.40	117,473.40
负债总计	-	-	-	241,143.52	241,143.52
利率敏感度缺口	183,165.71	-	-	245,194,235.30	245,377,401.01
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	621,421.62	-	-	-	621,421.62
结算备付金	6,027.14	-	-	-	6,027.14
存出保证金	2,253.15	-	-	-	2,253.15
交易性金融资产	-	-	-	297,165,242.29	297,165,242.29
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	-	-	-	49.51	49.51
资产总计	629,701.91	-	-	297,165,291.80	297,794,993.71
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	3.70	3.70
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	127,353.42	127,353.42
应付托管费	-	-	-	25,470.68	25,470.68
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	-	-	-	274,039.69	274,039.69
负债总计	-	-	-	426,867.49	426,867.49
利率敏感度缺口	629,701.91	-	-	296,738,424.31	297,368,126.22

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

## 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	0.00	0.00
	2.市场利率平行下降25个基点	0.00	0.00

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

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

## 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	245,435,378.82	100.02	297,165,242.29	99.93
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	245,435,378.82	100.02	297,165,242.29	99.93

#### 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%	12,219,953.26	14,803,681.58
2.组合自身基准下降 5%	-12,219,953.26	-14,803,681.58	

#### 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	245,201,276.97	296,439,888.60
第二层次	213,120.00	294,656.49
第三层次	20,981.85	430,697.20
合计	245,435,378.82	297,165,242.29

###### 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、债券和基金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		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票	
期初余额	-	430,697.20	430,697.20
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	126,017.83	126,017.83
转出第三层次	-	490,855.23	490,855.23
当期利得或损失总额	-	-44,877.95	-44,877.95
其中：计入损益的利得或损失	-	-44,877.95	-44,877.95
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	20,981.85	20,981.85
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	-	-8,139.65	-8,139.65
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	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	176,102.37	176,102.37
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	-	254,594.83	254,594.83
其中：计入损益的利得或损失	-	254,594.83	254,594.83
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	430,697.20	430,697.20
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	-	254,594.83	254,594.83

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	20,981.85	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2127~0.568	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	430,697.20	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.3138~2.7417	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本年度末,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 78,895,898.03 元(上年度:114,323,741.39 元),其中包括以股票支付的申购款 78,695,606.25 元和以现金支付的申购款 200,291.78 元(上年度:其中包括以股票支付的申购款 114,127,056.00 元和以现金支付的申购款 196,685.39 元)。

##### (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	245,435,378.82	99.93
	其中：股票	245,435,378.82	99.93
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	181,879.41	0.07
8	其他资产	1,286.30	0.00
9	合计	245,618,544.53	100.00

注：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；

## 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	6,219,465.92	2.53
B	采矿业	2,822,376.16	1.15
C	制造业	181,954,890.95	74.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,550,335.60	1.04
E	建筑业	331,416.10	0.14
F	批发和零售业	1,924,282.32	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	4,024,600.76	1.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,833,615.91	4.42
J	金融业	17,707,124.72	7.22
K	房地产业	4,863,746.53	1.98
L	租赁和商务服务业	2,625,058.78	1.07
M	科学研究和技术服务业	3,303,940.00	1.35
N	水利、环境和公共设施管理业	675,008.12	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	177,792.00	0.07
Q	卫生和社会工作	3,102,863.48	1.26

R	文化、体育和娱乐业	1,776,785.53	0.72
S	综合	452,371.53	0.18
	合计	245,345,674.41	99.99

### 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	89,704.41	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	89,704.41	0.04

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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	300750	宁德时代	28,100	11,055,102.00	4.51
2	000858	五粮液	40,141	7,253,077.29	2.96

3	000333	美的集团	107,442	5,565,495.60	2.27
4	002594	比亚迪	18,836	4,840,286.92	1.97
5	300059	东方财富	228,968	4,441,979.20	1.81
6	000568	泸州老窖	16,492	3,698,825.76	1.51
7	300760	迈瑞医疗	10,300	3,254,491.00	1.33
8	000651	格力电器	98,540	3,184,812.80	1.30
9	002475	立讯精密	99,908	3,172,079.00	1.29
10	002415	海康威视	85,481	2,964,481.08	1.21
11	002352	顺丰控股	49,483	2,858,138.08	1.16
12	300124	汇川技术	40,491	2,814,124.50	1.15
13	002714	牧原股份	54,103	2,637,521.25	1.07
14	002142	宁波银行	78,011	2,531,456.95	1.03
15	300274	阳光电源	22,135	2,474,693.00	1.01
16	000002	万科 A	135,558	2,467,155.60	1.01
17	000001	平安银行	187,212	2,463,709.92	1.00
18	300014	亿纬锂能	27,451	2,412,942.90	0.98
19	000725	京东方 A	702,742	2,375,267.96	0.97
20	300498	温氏股份	117,509	2,306,701.67	0.94
21	002304	洋河股份	13,261	2,128,390.50	0.87
22	300015	爱尔眼科	66,096	2,053,602.72	0.84
23	002129	TCL 中环	51,920	1,955,307.20	0.80
24	002049	紫光国微	14,378	1,895,307.96	0.77
25	000792	盐湖股份	79,300	1,799,317.00	0.73
26	002466	天齐锂业	22,700	1,793,073.00	0.73
27	000063	中兴通讯	68,233	1,764,505.38	0.72
28	002460	赣锋锂业	24,760	1,721,067.60	0.70
29	002027	分众传媒	223,196	1,490,949.28	0.61
30	300122	智飞生物	16,800	1,475,544.00	0.60
31	002812	恩捷股份	11,180	1,467,822.20	0.60
32	300142	沃森生物	35,800	1,438,802.00	0.59
33	002271	东方雨虹	42,263	1,418,768.91	0.58
34	002459	晶澳科技	23,540	1,414,518.60	0.58
35	002371	北方华创	5,800	1,306,740.00	0.53
36	002410	广联达	21,519	1,290,064.05	0.53
37	002230	科大讯飞	38,470	1,262,970.10	0.51
38	300347	泰格医药	11,600	1,215,680.00	0.50
39	000338	潍柴动力	113,708	1,157,547.44	0.47
40	002709	天赐材料	26,312	1,154,044.32	0.47
41	000625	长安汽车	91,436	1,125,577.16	0.46
42	000661	长春高新	6,700	1,115,215.00	0.45
43	300896	爱美客	1,900	1,076,065.00	0.44
44	002311	海大集团	17,240	1,064,225.20	0.43
45	002179	中航光电	18,305	1,057,296.80	0.43

46	000100	TCL 科技	278,071	1,034,424.12	0.42
47	000776	广发证券	62,659	970,587.91	0.40
48	002180	纳思达	18,300	949,587.00	0.39
49	002241	歌尔股份	54,310	914,037.30	0.37
50	000166	申万宏源	227,469	905,326.62	0.37
51	000733	振华科技	7,900	902,417.00	0.37
52	300661	圣邦股份	5,112	882,331.20	0.36
53	300450	先导智能	21,799	877,409.75	0.36
54	002050	三花智控	41,260	875,537.20	0.36
55	000596	古井贡酒	3,239	864,489.10	0.35
56	300408	三环集团	27,300	838,383.00	0.34
57	002493	荣盛石化	68,125	837,937.50	0.34
58	300316	晶盛机电	13,010	826,915.60	0.34
59	001979	招商蛇口	64,227	811,187.01	0.33
60	000538	云南白药	14,820	805,615.20	0.33
61	000963	华东医药	16,795	786,006.00	0.32
62	300759	康龙化成	11,450	778,600.00	0.32
63	002648	卫星化学	49,401	765,715.50	0.31
64	300782	卓胜微	6,686	764,209.80	0.31
65	300751	迈为股份	1,836	756,138.24	0.31
66	002340	格林美	99,400	738,542.00	0.30
67	000768	中航西飞	28,690	730,160.50	0.30
68	000799	酒鬼酒	5,200	717,288.00	0.29
69	002821	凯莱英	4,740	701,520.00	0.29
70	300012	华测检测	31,300	697,990.00	0.28
71	300496	中科创达	6,954	697,486.20	0.28
72	300763	锦浪科技	3,865	695,893.25	0.28
73	002384	东山精密	28,000	692,440.00	0.28
74	000938	紫光股份	35,158	685,932.58	0.28
75	002001	新和成	35,128	658,650.00	0.27
76	002202	金风科技	58,313	641,443.00	0.26
77	300207	欣旺达	30,100	636,615.00	0.26
78	002601	龙佰集团	33,300	630,036.00	0.26
79	002385	大北农	70,050	623,445.00	0.25
80	300003	乐普医疗	27,000	620,190.00	0.25
81	000895	双汇发展	23,624	612,570.32	0.25
82	002252	上海莱士	95,640	606,357.60	0.25
83	002074	国轩高科	21,000	605,430.00	0.25
84	300724	捷佳伟创	5,300	604,306.00	0.25
85	000876	新希望	46,752	603,568.32	0.25
86	000157	中联重科	108,727	591,474.88	0.24
87	002176	江特电机	33,500	584,575.00	0.24
88	300454	深信服	5,100	574,005.00	0.23

89	000425	徐工机械	111,008	562,810.56	0.23
90	300769	德方纳米	2,440	560,199.60	0.23
91	002920	德赛西威	5,300	558,302.00	0.23
92	300999	金龙鱼	12,458	542,670.48	0.22
93	002422	科伦药业	20,378	542,258.58	0.22
94	002736	国信证券	60,900	540,792.00	0.22
95	002966	苏州银行	69,180	538,220.40	0.22
96	002405	四维图新	48,296	532,221.92	0.22
97	300438	鹏辉能源	6,800	530,332.00	0.22
98	002738	中矿资源	7,900	526,614.00	0.21
99	000786	北新建材	20,200	522,776.00	0.21
100	002497	雅化集团	22,400	520,800.00	0.21
101	002555	三七互娱	28,700	519,470.00	0.21
102	000301	东方盛虹	39,700	517,688.00	0.21
103	002603	以岭药业	17,220	515,911.20	0.21
104	000807	云铝股份	46,000	511,520.00	0.21
105	002625	光启技术	29,990	510,429.80	0.21
106	002007	华兰生物	22,430	507,590.90	0.21
107	000933	神火股份	33,800	505,648.00	0.21
108	000983	山西焦煤	42,920	500,018.00	0.20
109	300073	当升科技	8,800	496,320.00	0.20
110	300146	汤臣倍健	21,700	495,194.00	0.20
111	300395	菲利华	9,000	495,000.00	0.20
112	000723	美锦能源	54,500	491,590.00	0.20
113	002407	多氟多	14,500	483,140.00	0.20
114	300390	天华超净	8,600	480,568.00	0.20
115	000630	铜陵有色	153,200	477,984.00	0.19
116	002185	华天科技	57,474	476,459.46	0.19
117	300285	国瓷材料	17,250	475,582.50	0.19
118	300144	宋城演艺	32,326	471,959.60	0.19
119	300699	光威复材	6,520	471,070.00	0.19
120	002028	思源电气	12,300	470,106.00	0.19
121	002008	大族激光	18,200	466,830.00	0.19
122	300568	星源材质	21,827	464,042.02	0.19
123	300037	新宙邦	10,600	460,782.00	0.19
124	000977	浪潮信息	21,286	458,074.72	0.19
125	000009	中国宝安	37,417	452,371.53	0.18
126	300433	蓝思科技	42,858	451,294.74	0.18
127	000683	远兴能源	57,100	447,664.00	0.18
128	000066	中国长城	43,838	447,147.60	0.18
129	000069	华侨城 A	83,749	446,382.17	0.18
130	000831	中国稀土	13,500	443,880.00	0.18
131	300033	同花顺	4,500	443,745.00	0.18

132	002192	融捷股份	4,500	440,550.00	0.18
133	002568	百润股份	11,700	437,112.00	0.18
134	002797	第一创业	77,540	436,550.20	0.18
135	002602	世纪华通	114,051	434,534.31	0.18
136	002756	永兴材料	4,700	433,199.00	0.18
137	002013	中航机电	43,078	432,933.90	0.18
138	300628	亿联网络	7,100	430,189.00	0.18
139	002236	大华股份	37,778	427,269.18	0.17
140	000932	华菱钢铁	89,040	418,488.00	0.17
141	000423	东阿阿胶	10,271	418,029.70	0.17
142	000783	长江证券	78,419	417,973.27	0.17
143	002120	韵达股份	28,961	416,459.18	0.17
144	003816	中国广核	154,300	415,067.00	0.17
145	002223	鱼跃医疗	13,000	414,180.00	0.17
146	002841	视源股份	7,000	413,280.00	0.17
147	000975	银泰黄金	37,204	410,732.16	0.17
148	300413	芒果超媒	13,600	408,272.00	0.17
149	300601	康泰生物	12,800	403,584.00	0.16
150	300957	贝泰妮	2,700	402,948.00	0.16
151	000516	国际医学	32,600	399,024.00	0.16
152	300253	卫宁健康	38,723	398,072.44	0.16
153	002025	航天电器	5,990	396,837.50	0.16
154	002439	启明星辰	15,000	391,200.00	0.16
155	002044	美年健康	63,456	388,985.28	0.16
156	000738	航发控制	15,050	385,882.00	0.16
157	000629	钒钛股份	81,400	385,022.00	0.16
158	002138	顺络电子	14,600	382,228.00	0.16
159	300223	北京君正	5,400	380,376.00	0.16
160	000999	华润三九	8,100	379,161.00	0.15
161	000728	国元证券	59,405	376,033.65	0.15
162	002268	电科网安	12,200	372,466.00	0.15
163	002078	太阳纸业	32,200	370,944.00	0.15
164	300777	中简科技	7,500	368,625.00	0.15
165	000762	西藏矿业	9,500	366,795.00	0.15
166	000998	隆平高科	22,600	363,182.00	0.15
167	000519	中兵红箭	18,400	361,376.00	0.15
168	300595	欧普康视	10,120	361,284.00	0.15
169	300118	东方日升	14,300	354,926.00	0.14
170	002532	天山铝业	45,400	350,488.00	0.14
171	002624	完美世界	27,250	346,620.00	0.14
172	002430	杭氧股份	8,800	346,368.00	0.14
173	002739	万达电影	24,700	345,800.00	0.14
174	002938	鹏鼎控股	12,600	345,744.00	0.14



175	002463	沪电股份	29,020	345,338.00	0.14
176	002294	信立泰	10,500	344,925.00	0.14
177	300308	中际旭创	12,760	344,902.80	0.14
178	002092	中泰化学	45,400	338,684.00	0.14
179	000408	藏格矿业	13,000	337,610.00	0.14
180	002557	洽洽食品	6,700	335,000.00	0.14
181	300357	我武生物	6,040	332,804.00	0.14
182	002507	涪陵榨菜	12,900	332,433.00	0.14
183	300604	长川科技	7,400	329,892.00	0.13
184	000591	太阳能	45,000	329,850.00	0.13
185	002056	横店东磁	17,600	329,824.00	0.13
186	002353	杰瑞股份	11,787	328,975.17	0.13
187	002673	西部证券	53,954	328,579.86	0.13
188	002030	达安基因	20,981	326,464.36	0.13
189	002080	中材科技	15,210	325,950.30	0.13
190	300054	鼎龙股份	15,200	323,608.00	0.13
191	000708	中信特钢	18,730	321,406.80	0.13
192	300832	新产业	6,400	320,896.00	0.13
193	002850	科达利	2,700	320,787.00	0.13
194	000860	顺鑫农业	10,720	319,670.40	0.13
195	002472	双环传动	12,400	315,580.00	0.13
196	002273	水晶光电	26,454	311,892.66	0.13
197	002156	通富微电	18,780	309,494.40	0.13
198	000818	航锦科技	11,300	309,055.00	0.13
199	002299	圣农发展	13,000	307,970.00	0.13
200	002465	海格通信	37,900	307,748.00	0.13
201	000703	恒逸石化	43,678	307,056.34	0.13
202	000988	华工科技	18,500	303,585.00	0.12
203	000960	锡业股份	21,500	303,150.00	0.12
204	002531	天顺风能	20,000	302,600.00	0.12
205	300633	开立医疗	5,500	301,565.00	0.12
206	002916	深南电路	4,172	301,009.80	0.12
207	002414	高德红外	27,323	300,553.00	0.12
208	300529	健帆生物	9,700	300,409.00	0.12
209	002444	巨星科技	15,800	299,884.00	0.12
210	300363	博腾股份	7,300	298,205.00	0.12
211	000155	川能动力	16,700	297,928.00	0.12
212	300373	扬杰科技	5,660	297,716.00	0.12
213	300346	南大光电	10,190	296,019.50	0.12
214	300136	信维通信	17,860	294,868.60	0.12
215	300919	中伟股份	4,400	288,684.00	0.12
216	000739	普洛药业	13,400	288,636.00	0.12
217	002518	科士达	5,000	288,000.00	0.12

218	000970	中科三环	21,070	287,394.80	0.12
219	000878	云南铜业	24,396	286,653.00	0.12
220	000623	吉林敖东	19,118	286,578.82	0.12
221	000039	中集集团	40,690	286,457.60	0.12
222	002508	老板电器	10,260	284,817.60	0.12
223	300725	药石科技	3,530	284,165.00	0.12
224	000400	许继电气	14,200	283,574.00	0.12
225	002152	广电运通	28,500	283,290.00	0.12
226	002600	领益智造	62,300	282,842.00	0.12
227	002409	雅克科技	5,600	282,072.00	0.11
228	002487	大金重工	6,800	281,316.00	0.11
229	000729	燕京啤酒	26,300	279,306.00	0.11
230	002245	蔚蓝锂芯	18,700	278,256.00	0.11
231	300035	中科电气	13,500	277,830.00	0.11
232	002865	钧达股份	1,500	277,650.00	0.11
233	000830	鲁西化工	22,400	277,536.00	0.11
234	002203	海亮股份	24,500	276,850.00	0.11
235	002262	恩华药业	11,200	274,960.00	0.11
236	002436	兴森科技	28,300	273,944.00	0.11
237	002831	裕同科技	8,280	273,819.60	0.11
238	000690	宝新能源	42,000	273,000.00	0.11
239	000617	中油资本	48,800	271,816.00	0.11
240	000513	丽珠集团	8,360	271,532.80	0.11
241	002372	伟星新材	12,720	271,444.80	0.11
242	300558	贝达药业	5,500	270,985.00	0.11
243	002506	协鑫集成	93,000	270,630.00	0.11
244	000547	航天发展	28,800	270,432.00	0.11
245	300676	华大基因	5,200	268,788.00	0.11
246	300088	长信科技	45,004	268,673.88	0.11
247	002683	广东宏大	9,900	266,904.00	0.11
248	000893	亚钾国际	9,800	266,364.00	0.11
249	300034	钢研高纳	5,800	265,872.00	0.11
250	300474	景嘉微	4,850	264,664.50	0.11
251	002065	东华软件	46,500	263,190.00	0.11
252	000877	天山股份	30,800	262,416.00	0.11
253	300244	迪安诊断	10,396	261,251.48	0.11
254	002064	华峰化学	38,400	261,120.00	0.11
255	002791	坚朗五金	2,500	259,875.00	0.11
256	002389	航天彩虹	12,600	259,182.00	0.11
257	000887	中鼎股份	17,900	259,013.00	0.11
258	000750	国海证券	77,625	258,491.25	0.11
259	000875	吉电股份	42,300	257,607.00	0.10
260	002402	和而泰	17,600	256,608.00	0.10

261	000636	风华高科	17,200	255,076.00	0.10
262	300487	蓝晓科技	3,600	250,524.00	0.10
263	300296	利亚德	44,250	250,455.00	0.10
264	300017	网宿科技	44,845	250,235.10	0.10
265	002183	怡亚通	38,840	249,741.20	0.10
266	002747	埃斯顿	11,500	249,320.00	0.10
267	300383	光环新网	30,300	247,248.00	0.10
268	002484	江海股份	11,000	246,070.00	0.10
269	300058	蓝色光标	48,634	245,601.70	0.10
270	002456	欧菲光	52,002	244,929.42	0.10
271	002312	川发龙蟒	23,200	244,064.00	0.10
272	002936	郑州银行	103,791	243,908.85	0.10
273	002926	华西证券	32,200	242,466.00	0.10
274	002250	联化科技	15,600	241,800.00	0.10
275	002541	鸿路钢构	8,200	240,178.00	0.10
276	002958	青农商行	82,800	239,292.00	0.10
277	300418	昆仑万维	16,500	237,765.00	0.10
278	300803	指南针	5,200	237,744.00	0.10
279	002145	中核钛白	38,585	237,683.60	0.10
280	002195	二三四五	116,905	234,979.05	0.10
281	300682	朗新科技	10,550	231,889.00	0.09
282	300502	新易盛	9,762	231,847.50	0.09
283	002212	天融信	23,200	231,768.00	0.09
284	002408	齐翔腾达	32,820	231,052.80	0.09
285	300026	红日药业	40,600	230,608.00	0.09
286	002617	露笑科技	24,900	229,827.00	0.09
287	300432	富临精工	15,900	229,437.00	0.09
288	300298	三诺生物	6,800	229,364.00	0.09
289	300024	机器人	25,490	228,900.20	0.09
290	300294	博雅生物	6,250	228,500.00	0.09
291	300748	金力永磁	7,800	228,228.00	0.09
292	002572	索菲亚	12,564	228,162.24	0.09
293	300775	三角防务	6,000	228,000.00	0.09
294	002500	山西证券	42,780	226,734.00	0.09
295	002368	太极股份	8,059	226,699.67	0.09
296	000060	中金岭南	55,145	226,094.50	0.09
297	002675	东诚药业	13,600	225,216.00	0.09
298	002131	利欧股份	127,143	225,043.11	0.09
299	000021	深科技	21,000	224,490.00	0.09
300	002597	金禾实业	6,900	224,250.00	0.09
301	300009	安科生物	23,767	222,459.12	0.09
302	300666	江丰电子	3,200	221,440.00	0.09
303	002706	良信股份	15,100	221,215.00	0.09

304	000050	深天马 A	25,400	219,964.00	0.09
305	000403	派林生物	9,600	218,496.00	0.09
306	300776	帝尔激光	1,727	217,602.00	0.09
307	000997	新大陆	16,580	215,705.80	0.09
308	002155	湖南黄金	16,600	214,970.00	0.09
309	002128	电投能源	17,400	214,716.00	0.09
310	002727	一心堂	6,800	214,268.00	0.09
311	002151	北斗星通	7,600	213,408.00	0.09
312	300567	精测电子	4,250	213,350.00	0.09
313	300850	新强联	4,000	213,120.00	0.09
314	002244	滨江集团	24,100	212,803.00	0.09
315	003022	联泓新科	7,000	212,450.00	0.09
316	300679	电连技术	5,700	210,900.00	0.09
317	300001	特锐德	13,700	208,377.00	0.08
318	002558	巨人网络	26,100	207,756.00	0.08
319	002851	麦格米特	8,000	207,680.00	0.08
320	300866	安克创新	3,500	207,445.00	0.08
321	000825	太钢不锈	48,000	207,360.00	0.08
322	300451	创业慧康	26,145	206,806.95	0.08
323	300251	光线传媒	23,820	206,281.20	0.08
324	002595	豪迈科技	8,900	206,035.00	0.08
325	002124	天邦食品	33,600	205,296.00	0.08
326	300677	英科医疗	9,720	204,411.60	0.08
327	002153	石基信息	13,614	204,073.86	0.08
328	002511	中顺洁柔	14,800	203,352.00	0.08
329	000581	威孚高科	11,451	203,026.23	0.08
330	300618	寒锐钴业	5,044	202,012.20	0.08
331	300182	捷成股份	45,059	201,413.73	0.08
332	300458	全志科技	9,892	201,401.12	0.08
333	002373	千方科技	22,500	200,700.00	0.08
334	301050	雷电微力	2,600	200,642.00	0.08
335	000686	东北证券	30,800	200,200.00	0.08
336	000778	新兴铸管	54,432	198,676.80	0.08
337	002019	亿帆医药	16,200	198,450.00	0.08
338	002585	双星新材	15,500	197,625.00	0.08
339	002266	浙富控股	50,530	197,572.30	0.08
340	002701	奥瑞金	39,000	196,950.00	0.08
341	000012	南玻 A	29,346	196,911.66	0.08
342	300773	拉卡拉	11,600	195,808.00	0.08
343	002002	鸿达兴业	60,257	195,232.68	0.08
344	000951	中国重汽	13,140	194,997.60	0.08
345	300979	华利集团	3,400	194,174.00	0.08
346	000709	河钢股份	85,800	193,908.00	0.08

347	300070	碧水源	40,234	190,306.82	0.08
348	002396	星网锐捷	9,900	189,684.00	0.08
349	002127	南极电商	39,300	189,033.00	0.08
350	000027	深圳能源	29,440	187,238.40	0.08
351	000401	冀东水泥	22,464	184,878.72	0.08
352	000032	深桑达 A	9,100	183,365.00	0.07
353	002985	北摩高科	4,021	181,347.10	0.07
354	002643	万润股份	12,350	181,051.00	0.07
355	002249	大洋电机	35,234	180,398.08	0.07
356	000035	中国天楹	35,500	179,985.00	0.07
357	300115	长盈精密	17,288	178,585.04	0.07
358	000656	金科股份	93,500	178,585.00	0.07
359	002607	中公教育	38,400	177,792.00	0.07
360	300482	万孚生物	5,570	177,515.90	0.07
361	000785	居然之家	43,200	176,688.00	0.07
362	002505	鹏都农牧	68,110	175,723.80	0.07
363	002984	森麒麟	5,700	175,503.00	0.07
364	002091	江苏国泰	20,600	175,100.00	0.07
365	300737	科顺股份	13,900	174,862.00	0.07
366	301035	润丰股份	2,000	174,200.00	0.07
367	000883	湖北能源	40,900	171,780.00	0.07
368	300888	稳健医疗	2,400	171,600.00	0.07
369	300672	国科微	2,000	170,100.00	0.07
370	300861	美畅股份	3,420	168,127.20	0.07
371	002939	长城证券	20,300	168,084.00	0.07
372	300463	迈克生物	9,700	167,810.00	0.07
373	300623	捷捷微电	8,100	167,022.00	0.07
374	300476	胜宏科技	12,900	166,926.00	0.07
375	002004	华邦健康	32,600	166,260.00	0.07
376	000810	创维数字	11,800	164,492.00	0.07
377	002839	张家港行	35,660	164,392.60	0.07
378	002690	美亚光电	6,850	163,715.00	0.07
379	002032	苏泊尔	3,300	163,218.00	0.07
380	300674	宇信科技	11,600	162,980.00	0.07
381	002085	万丰奥威	26,828	159,626.60	0.07
382	000089	深圳机场	20,200	158,772.00	0.06
383	301155	海力风电	1,800	157,230.00	0.06
384	002041	登海种业	7,900	156,578.00	0.06
385	300376	易事特	22,900	156,407.00	0.06
386	000930	中粮科技	18,700	156,332.00	0.06
387	002099	海翔药业	22,300	156,323.00	0.06
388	000902	新洋丰	13,502	155,408.02	0.06
389	300685	艾德生物	5,740	151,823.00	0.06

390	002191	劲嘉股份	20,975	151,649.25	0.06
391	300747	锐科激光	6,410	151,596.50	0.06
392	002157	正邦科技	35,400	149,742.00	0.06
393	300072	海新能科	34,340	149,722.40	0.06
394	002081	金螳螂	30,526	148,051.10	0.06
395	002221	东华能源	19,400	148,022.00	0.06
396	000987	越秀资本	24,686	147,869.14	0.06
397	002429	兆驰股份	42,300	147,627.00	0.06
398	002745	木林森	18,200	147,602.00	0.06
399	000937	冀中能源	23,100	146,916.00	0.06
400	000540	中天金融	97,100	146,621.00	0.06
401	300459	汤姆猫	45,989	144,865.35	0.06
402	300630	普利制药	5,863	144,581.58	0.06
403	300973	立高食品	1,500	144,270.00	0.06
404	002048	宁波华翔	10,300	143,170.00	0.06
405	000156	华数传媒	19,100	143,059.00	0.06
406	300671	富满微	3,500	143,045.00	0.06
407	001965	招商公路	18,400	142,968.00	0.06
408	002468	申通快递	13,700	141,521.00	0.06
409	002010	传化智联	26,400	140,976.00	0.06
410	000598	兴蓉环境	28,800	140,832.00	0.06
411	001914	招商积余	9,000	138,420.00	0.06
412	002281	光迅科技	8,700	136,764.00	0.06
413	000537	广宇发展	10,300	136,269.00	0.06
414	000800	一汽解放	17,600	136,048.00	0.06
415	300456	赛微电子	9,200	135,976.00	0.06
416	002948	青岛银行	40,390	135,710.40	0.06
417	000402	金融街	25,663	134,730.75	0.05
418	300457	赢合科技	7,600	134,292.00	0.05
419	000712	锦龙股份	10,300	133,282.00	0.05
420	300171	东富龙	5,600	132,888.00	0.05
421	003035	南网能源	23,400	132,678.00	0.05
422	000559	万向钱潮	27,240	132,658.80	0.05
423	000415	渤海租赁	59,760	132,069.60	0.05
424	301071	力量钻石	1,100	131,065.00	0.05
425	002216	三全食品	7,040	130,310.40	0.05
426	002237	恒邦股份	12,300	129,642.00	0.05
427	000528	柳工	21,860	128,536.80	0.05
428	002626	金达威	6,200	128,464.00	0.05
429	000898	鞍钢股份	47,769	127,543.23	0.05
430	002867	周大生	8,925	125,217.75	0.05
431	002390	信邦制药	26,550	124,785.00	0.05
432	300638	广和通	6,950	124,405.00	0.05

433	300726	宏达电子	2,800	123,592.00	0.05
434	300257	开山股份	8,200	123,000.00	0.05
435	002906	华阳集团	3,700	122,914.00	0.05
436	000627	天茂集团	38,200	120,712.00	0.05
437	000555	神州信息	11,200	120,624.00	0.05
438	000563	陕国投 A	39,730	120,381.90	0.05
439	301047	义翘神州	1,200	119,592.00	0.05
440	002612	朗姿股份	4,300	119,368.00	0.05
441	300841	康华生物	1,400	118,468.00	0.05
442	002773	康弘药业	7,390	115,949.10	0.05
443	000921	海信家电	8,800	115,896.00	0.05
444	003031	中瓷电子	1,200	115,560.00	0.05
445	000935	四川双马	5,400	113,400.00	0.05
446	002110	三钢闽光	23,850	112,095.00	0.05
447	000927	中国铁物	40,000	111,600.00	0.05
448	002705	新宝股份	6,700	111,555.00	0.05
449	002423	中粮资本	15,500	110,980.00	0.05
450	300428	立中集团	4,400	108,900.00	0.04
451	001203	大中矿业	8,400	108,612.00	0.04
452	000959	首钢股份	28,800	108,576.00	0.04
453	000967	盈峰环境	23,600	107,144.00	0.04
454	002498	汉缆股份	25,500	106,590.00	0.04
455	000539	粤电力 A	18,700	103,785.00	0.04
456	000685	中山公用	14,740	103,622.20	0.04
457	301029	怡合达	1,560	102,554.40	0.04
458	000688	国城矿业	6,300	102,123.00	0.04
459	000672	上峰水泥	9,540	101,887.20	0.04
460	002434	万里扬	12,600	101,430.00	0.04
461	000990	诚志股份	11,400	100,320.00	0.04
462	002146	荣盛发展	45,400	98,518.00	0.04
463	002925	盈趣科技	5,930	97,963.60	0.04
464	002242	九阳股份	5,800	95,584.00	0.04
465	000961	中南建设	42,500	93,075.00	0.04
466	300761	立华股份	2,700	92,475.00	0.04
467	000028	国药一致	2,800	92,092.00	0.04
468	002670	国盛金控	12,360	91,587.60	0.04
469	002967	广电计量	5,400	90,612.00	0.04
470	000966	长源电力	18,900	87,507.00	0.04
471	300821	东岳硅材	7,400	86,432.00	0.04
472	000062	深圳华强	7,012	85,616.52	0.03
473	301078	孩子王	6,600	85,470.00	0.03
474	002653	海思科	3,800	84,550.00	0.03
475	002563	森马服饰	16,100	84,364.00	0.03

476	002945	华林证券	6,200	81,716.00	0.03
477	002608	江苏国信	13,700	81,652.00	0.03
478	000582	北部湾港	10,900	80,551.00	0.03
479	002399	海普瑞	6,020	77,357.00	0.03
480	001213	中铁特货	17,600	76,032.00	0.03
481	002320	海峡股份	13,725	75,487.50	0.03
482	001872	招商港口	5,200	74,672.00	0.03
483	000869	张裕 A	2,400	72,576.00	0.03
484	000553	安道麦 A	7,900	71,495.00	0.03
485	301219	腾远钴业	1,000	68,930.00	0.03
486	000958	电投产融	15,200	67,792.00	0.03
487	002461	珠江啤酒	8,000	64,080.00	0.03
488	301236	软通动力	1,800	63,324.00	0.03
489	300741	华宝股份	2,600	61,178.00	0.02
490	001289	龙源电力	3,000	54,810.00	0.02
491	300894	火星人	2,000	50,560.00	0.02
492	301177	迪阿股份	800	50,384.00	0.02
493	002978	安宁股份	1,500	50,040.00	0.02
494	001227	兰州银行	13,000	49,010.00	0.02
495	003039	顺控发展	2,700	45,657.00	0.02
496	002901	大博医疗	1,200	40,836.00	0.02
497	301268	铭利达	800	40,168.00	0.02
498	001308	康冠科技	1,200	37,248.00	0.02
499	301207	华兰疫苗	800	35,664.00	0.01
500	301200	大族数控	900	35,280.00	0.01

### 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	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.03
2	301327	华宝新能	97	17,166.09	0.01
3	301309	万得凯	156	3,815.76	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	002466	天齐锂业	2,543,142.93	0.86
2	002738	中矿资源	666,342.40	0.22



3	000792	盐湖股份	639,548.00	0.22
4	300363	博腾股份	543,580.85	0.18
5	300438	鹏辉能源	536,710.00	0.18
6	000519	中兵红箭	515,569.00	0.17
7	002192	融捷股份	497,127.00	0.17
8	300750	宁德时代	489,709.00	0.16
9	300395	菲利华	482,312.00	0.16
10	000762	西藏矿业	448,203.00	0.15
11	300059	东方财富	436,478.00	0.15
12	300919	中伟股份	411,129.96	0.14
13	000408	藏格矿业	406,999.00	0.14
14	000516	国际医学	397,179.00	0.13
15	002352	顺丰控股	350,447.00	0.12
16	300035	中科电气	340,447.00	0.11
17	300850	新强联	325,209.00	0.11
18	002472	双环传动	310,434.00	0.10
19	002739	万达电影	306,714.00	0.10
20	000875	吉电股份	305,878.00	0.10

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	000858	五粮液	603,838.00	0.20
2	000333	美的集团	434,785.19	0.15
3	300059	东方财富	403,955.00	0.14
4	000651	格力电器	381,243.00	0.13
5	002594	比亚迪	360,175.00	0.12
6	000568	泸州老窖	337,801.00	0.11
7	002475	立讯精密	273,383.00	0.09
8	000516	国际医学	237,778.00	0.08
9	300379	东方通	226,794.80	0.08
10	000002	万科 A	224,329.00	0.08
11	002142	宁波银行	222,350.00	0.07
12	300212	易华录	219,829.77	0.07
13	000001	平安银行	218,555.00	0.07
14	002415	海康威视	218,125.00	0.07
15	300068	南都电源	215,729.10	0.07
16	002332	仙琚制药	205,207.00	0.07
17	300014	亿纬锂能	204,753.00	0.07

18	002074	国轩高科	201,119.00	0.07
19	300315	掌趣科技	197,148.00	0.07
20	300070	碧水源	188,887.00	0.06

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	29,348,174.05
卖出股票收入（成交）总额	27,443,399.77

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

无。

#### 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	1,286.30
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,286.30

### 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 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	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
----	------	------	----------------	--------------	----------

1	301327	华宝新能	17,166.09	0.01	新股锁定期
2	301309	万得凯	3,815.76	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		南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,548	41,810.58	8,771,421.00	4.61%	68,617,712.00	36.09%	112,765,374.00	59.30%

### 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	中信证券股份有限公司	3,550,128.00	1.87%
2	章斌	2,526,375.00	1.33%
3	广发证券股份有限公司	2,402,636.00	1.26%
4	海通证券股份有限公司	1,345,543.00	0.71%
5	郝世军	911,711.00	0.48%
6	浙江华浙白马房地产开发有限公司	910,052.00	0.48%
7	黎彩贞	904,800.00	0.48%
8	吴飞	737,889.00	0.39%
9	陈志彪	716,192.00	0.38%
10	项志英	700,000.00	0.37%
11	中国工商银行股份有限公司-南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	112,765,374.00	59.30%

### 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。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年12月4日)基金份额总额	4,127,538,537.00
本报告期期初基金份额总额	172,154,507.00
本报告期基金总申购份额	57,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	39,000,000.00
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	190,154,507.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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）。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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13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45,000.00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

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	2	55,051,219.68	100.00%	5,506.50	100.00%	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-0.14	0.00%	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

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

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

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

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

无

退租交易单元：

无

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	392,471.69	98.55%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	5,760.53	1.45%	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

### 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基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-12
4	南方基金关于旗下部分基金增加华安证券为申购赎回代理券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-06
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-22
6	南方基金管理股份有限公司关于修订公司旗下部分公开募集证券投资基金基金合同有关条款的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-17
7	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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-27
8	南方基金管理股份有限公司关于董事长变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-28
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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-09
12	关于深证成份交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-04
13	关于深证成份交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-05
14	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-16
15	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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-16
16	关于深证成份交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-19
17	关于深证成份交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-29

## § 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
联接基金	1	20220101-20221231	105,964,874.00	24,800,500.00	18,000,000.00	112,765,374.00	59.30%

#### 产品特有风险

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

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

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