南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金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：招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。

基金托管人招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.....7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....9
§4 管理人报告.....9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....12
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.....13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....16
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....16
§5 托管人报告.....16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....16
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17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....17
§6 审计报告.....17
6.1 审计报告基本信息.....17
6.2 审计报告的基本内容.....17
§7 年度财务报表.....19
7.1 资产负债表.....19
7.2 利润表.....21
7.3 净资产（基金净值）变动表.....22
7.4 报表附注.....24
§8 投资组合报告.....57
8.1 期末基金资产组合情况.....57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....58
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.....59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....66
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.....66

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.....66
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.....66
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.....67
8.12 投资组合报告附注.....67
§9 基金份额持有人信息.....68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....69
9.4 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.....69
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....69
§10 开放式基金份额变动.....69
§11 重大事件揭示.....70
11.1 基金份额持有人大会决议.....70
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.....70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....70
11.4 基金投资策略的改变.....70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....70
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.....70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....71
11.8 其他重大事件.....73
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....75
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.....75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....75
§13 备查文件目录.....75
13.1 备查文件目录.....75
13.2 存放地点.....75
13.3 查阅方式.....76

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金	
基金简称	南方创新精选一年定开混合发起	
基金主代码	009681	
交易代码	009681	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 7 月 21 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,043,551,418.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方创新精选一年定开混合发起 A	南方创新精选一年定开混合发起 C
下属分级基金的交易代码	009681	009682
报告期末下属分级基金的份额总额	759,707,349.83 份	283,844,068.93 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化行业深度研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金利用相对价值评估，形成最终的股票组合进行投资。相对价值评估主要运用国际化视野，采用专业的估值模型，合理使用估值指标，将国内上市公司的有关估值与国际公司相应指标进行比较，选择其中价值被低估的公司。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*45%+中国战略新兴产业成份指数收益率*15%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%+中债总指数收益率*30%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。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、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	张燕
	联系电话	0755-82763888	0755-83199084

	电子邮箱	manager@southernfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95555
传真		0755-82763889	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518017	518040
法定代表人		周易	缪建民

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

1、南方创新精选一年定开混合发起A

3.1.1 期间数据和指标	2022年	2021年	2020年7月21日-2020年12月31日
本期已实现收益	-166,166,698.72	179,451,512.27	-1,368,886.57
本期利润	-249,569,017.50	81,374,233.83	186,359,185.93
加权平均基金份额本期利润	-0.2928	0.0588	0.1063
本期加权平均净值利润率	-32.16%	5.21%	10.50%
本期基金份额净值增长率	-25.49%	2.39%	10.63%
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	-118,477,164.65	122,206,887.20	-1,368,886.57
期末可供分配基金份额利润	-0.1560	0.1324	-0.0008
期末基金资产净值	641,230,185.18	1,045,419,350.00	1,939,052,132.68
期末基金份额净值	0.8440	1.1327	1.1063
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	-15.60%	13.27%	10.63%

2、南方创新精选一年定开混合发起C

3.1.1 期间数据和指标	2022年	2021年	2020年7月21日-2020年12月31日
本期已实现收益	-64,449,245.34	69,775,591.63	-2,556,019.42
本期利润	-95,613,639.18	28,062,618.94	75,698,886.06
加权平均基金份额本期利润	-0.2956	0.0498	0.1034
本期加权平均净值利润率	-32.83%	4.43%	10.23%
本期基金份额净值增长率	-25.93%	1.77%	10.34%
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	-47,765,745.04	43,173,128.36	-2,556,019.42
期末可供分配基金份额利润	-0.1683	0.1221	-0.0035
期末基金资产净值	236,078,323.89	396,765,951.28	807,961,145.84
期末基金份额净值	0.8317	1.1229	1.1034
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	-16.83%	12.29%	10.34%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方创新精选一年定开混合发起A

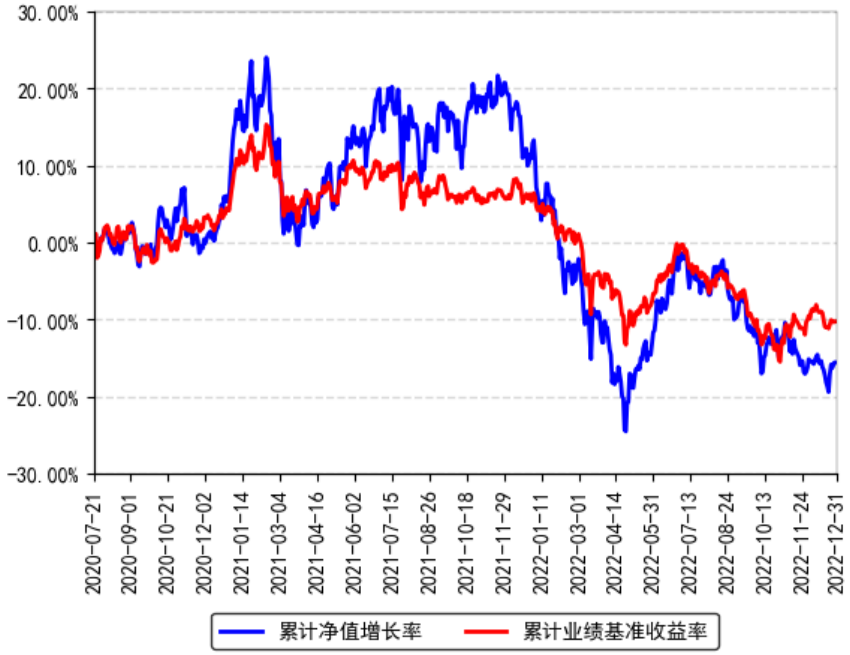
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.08%	1.13%	2.17%	0.89%	-3.25%	0.24%
过去六个月	-13.91%	1.15%	-9.72%	0.79%	-4.19%	0.36%
过去一年	-25.49%	1.54%	-15.67%	0.94%	-9.82%	0.60%
自基金合同生效起至今	-15.60%	1.51%	-10.28%	0.86%	-5.32%	0.65%

南方创新精选一年定开混合发起C

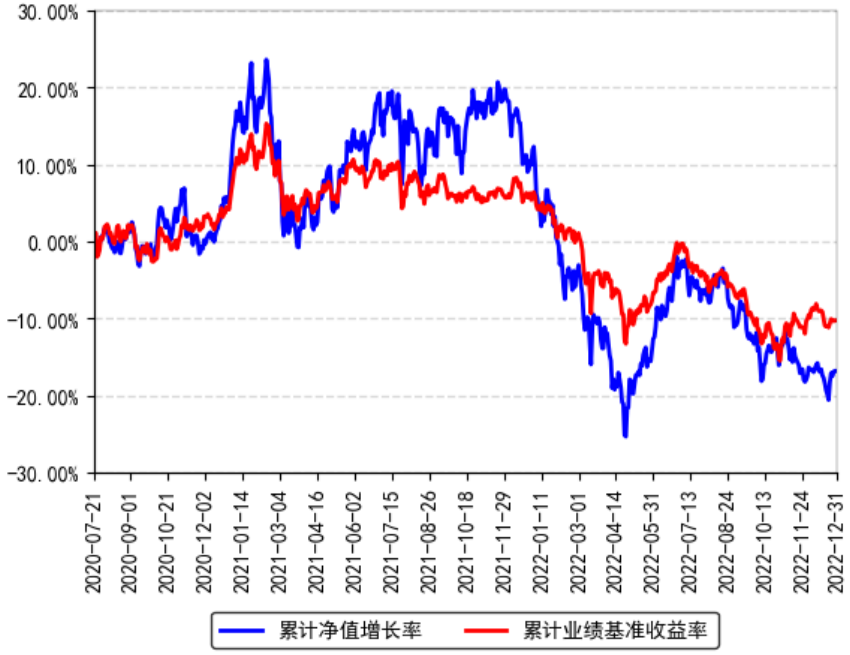
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.22%	1.13%	2.17%	0.89%	-3.39%	0.24%
过去六个月	-14.18%	1.15%	-9.72%	0.79%	-4.46%	0.36%
过去一年	-25.93%	1.54%	-15.67%	0.94%	-10.26%	0.60%
自基金合同生效起至今	-16.83%	1.51%	-10.28%	0.86%	-6.55%	0.65%

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

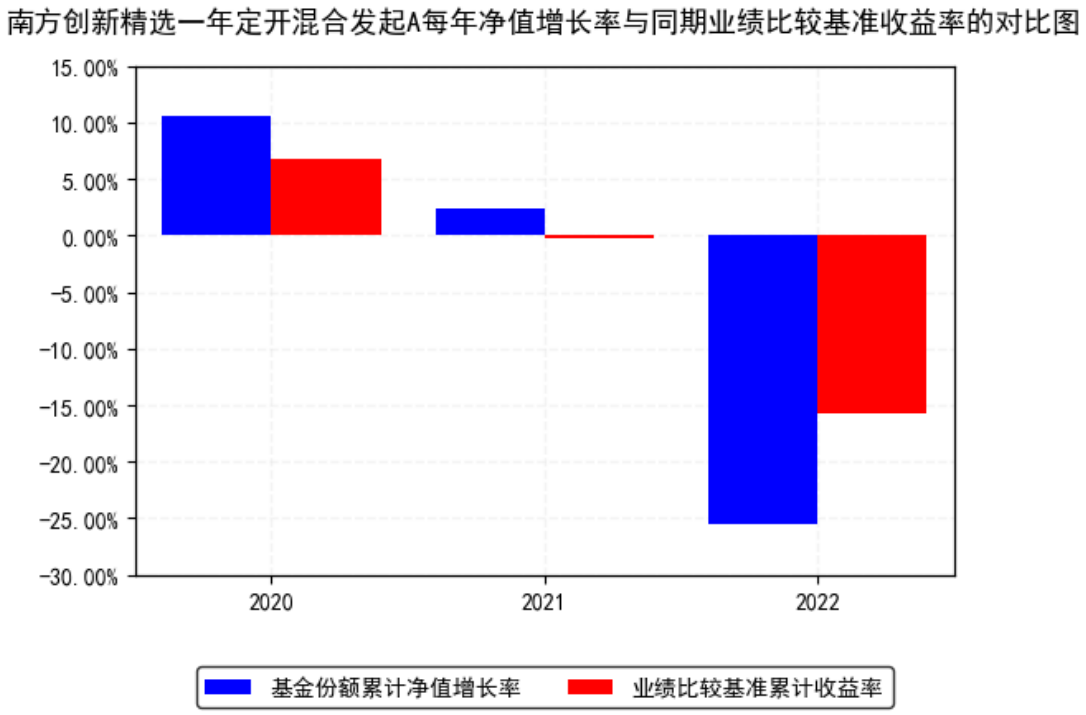
南方创新精选一年定开混合发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

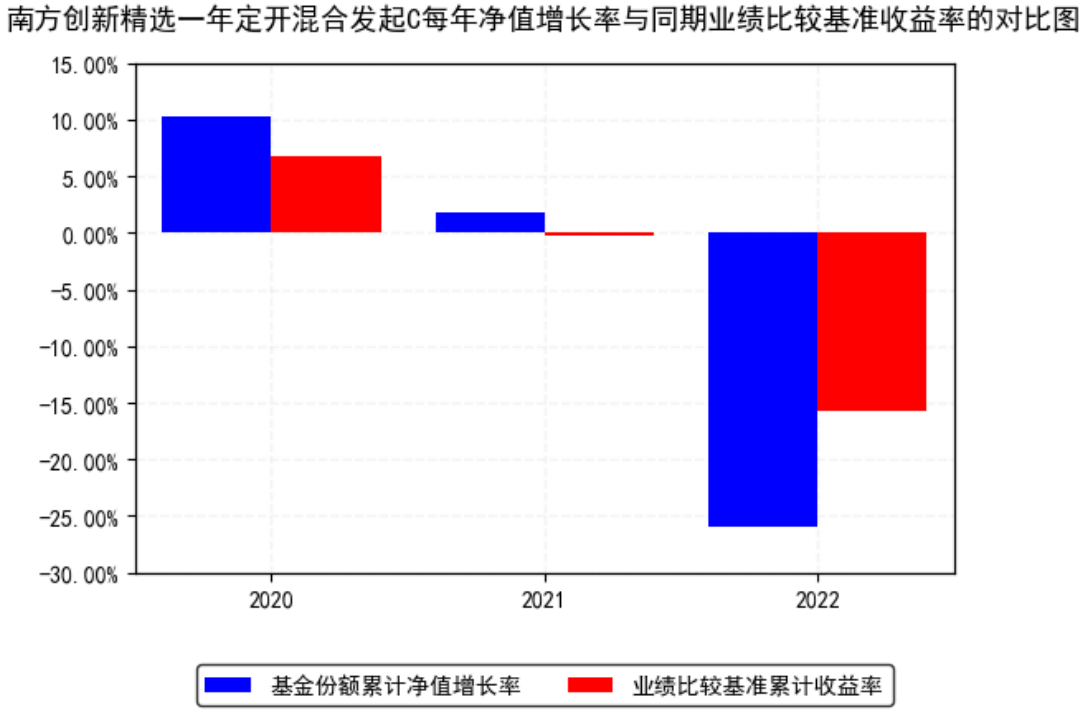


南方创新精选一年定开混合发起C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 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





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 2020 年 7 月 21 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		
罗安安	本基金基金经理	2020 年 7 月 21 日	-	12 年	清华大学计算机科学与技术专业博士，具有基金从业资格，2010 年 7 月加入南方基金，担任研究部高级研究员；2014 年 3 月 31 日至 2014 年 11 月 5 日，任南方成长、南方价值基金经理助理；2014 年 11 月 5 日至 2015 年 7 月 10 日，任投资经理；2018 年 6 月 8 日至 2021 年 6 月 4 日，任南方国策动力基金经理；2015 年 7 月 10 日至今，任南方价值基金经理；2017 年 12 月 15 日至今，任南方新兴混合基金经理；2018 年 10 月 12 日至今，任南方人工智能混合基金经理；2020 年 7 月 16 日至今，任南方核心成长混合基金经理；2020 年 7 月 20 日至今，兼任投资经理；2020 年 7 月 21 日至今，任南方创新精选一年混合基金经理；2020 年 9

					月 18 日至今，任南方创新成长混合基金经理；2022 年 1 月 5 日至今，任南方专精特新混合基金经理；2022 年 2 月 18 日至今，任南方新兴产业混合基金经理。
雷嘉源	本基金基金经理	2020 年 8 月 21 日	-	13 年	北京大学金融学硕士，具有基金从业资格。2009 年 7 月加入南方基金，任权益研究部研究员，负责公用事业、新能源及新三板的研究工作。2015 年 2 月 26 日至 2015 年 4 月 16 日，任南方避险、南方保本基金经理助理；2015 年 4 月 16 日至 2015 年 12 月 3 日，任权益专户投资部投资经理。2015 年 12 月调入南方基金子公司南方资本，任投资管理部投资经理，负责新三板投资业务。2020 年 5 月从子公司南方资本调入南方基金；2021 年 2 月 5 日至 2021 年 6 月 17 日，任南方智造股票基金经理；2020 年 8 月 21 日至今，任南方创新精选一年混合基金经理；2021 年 6 月 4 日至今，任南方国策动力基金经理；2021 年 11 月 23 日至今，任南方北交所精选两年定开混合发起基金经理；2022 年 1 月 5 日至今，任南方专精特新混合基金经理；2022 年 10 月 21 日至今，任南方安养混合基金经理；2022 年 11 月 11 日至今，任南方均衡优选一年持有期混合基金经理。

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
罗安安	公募基金	8	5,464,815,380.83	2015 年 07 月 10 日
	私募资产管理计划	1	152,168,776.13	2021 年 01 月 21 日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	5,616,984,156.96	-

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遵规守信情况的说明

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，并且交易占优比也没有明显异常，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

2022 年已经结束，A 股整体弱市，上证指数下跌 15.13%，沪深 300 下跌 21.63%，创业板指更是下跌 29.17%，整体反映了世界政治经济格局剧烈波动，过去的一年是美联储持续加息缩表和美元强势的一年，也是中国经济持续探底并努力走出新冠疫情影响的一年。毫无疑问，市场的政策底已经出现，随着二十大胜利召开，托底经济的政策和走出疫情的措施正在加速推出，市场围绕 3000 点指数关口情绪逐步转向乐观，场外资金在等待美国加息力度还能持续多久的信号，美国衰退预期带来的出口增速可能阶段性走弱，但我们判断美国经济仍然具有韧性，重点关注美债收益率和美联储的货币政策变化等外部干扰因素。同时，未来重点关注新一届政府的经济增长措施和政策支持方向。

去年上半年，我们意识到美国加息对流动性的风险，仓位集中在新能源车、军工、光伏、风电等领域的龙头公司，仍然成长板块的行业龙头公司可以抵御市场的波动，但事与愿违，即使在新能源车 4 月份反弹以来，龙头公司涨幅都有限，更多是二三线小市值公司的弹性更大。而持仓中的高端制造个股也受到下游景气度的影响，表现普通。

下半年以来，我们在新能源车龙头公司上造成了不小的亏损，三季度后及时调整持仓策略，分散布局龙头的策略逐步偏向集中于底部成长策略，通过产业调研，选择了一批业绩今明两年增速确定且产业竞争力明确的个股，从产业趋势和景气度的角度去提高胜率。配置方向主要是我们一直以来看好的高端制造业，以及重点关注数字经济的投资机会，目前股票仓位较高，增加部分计算机个股，仓位以互联网、计算机、军工科技、高端制造中材料设备类公司为主。

目前北交所的股票去年受益于流动性影响，并没有太多盈利机会，我们认为今年会是政策修复期，仍然以稳健龙头个股为主。

回顾过去一年，虽然 A 股去年整体较弱，但市场又持续有机会、结构强势的板块不断涌现，比如上半年的新能源车、煤炭、军工，下半年的风电、计算机、医药，每次板块上涨的幅度都不算小，这点从 28 个行业的去年涨跌幅，以及公募基金净值分化较大也能看出。从结果上看，基金净值不理想的原因是，从机构的角度来看，捕捉投资机会又有难度，体现在：

1）板块上涨更多体现在二三线标的，而行业龙头的涨幅有限，市场更偏好弹性大的小市值公司；2）板块的投资节奏提前，往往等待右侧投资机会出现的基金经理会滞后，左侧布局反而更容易获利；3） 板块上涨快速形成共识，导致波动加剧，边际信息推动公司走势，大量短期交易资金又加大了波动。总结一句话，尽管市场弱势但机会仍不少，我们努力做到领先市场研究，勇于把投资策略和投资思路充分体现在基金持仓的个股上，做到知行合一。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金A份额净值为0.8440元，报告期内，份额净值增长率为-25.49%，同期业绩基准增长率为-15.67%；本基金C份额净值为0.8317元，报告期内，份额净值增长率为-25.93%，同期业绩基准增长率为-15.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为2023年市场更看重宏观总量增长的逻辑，应该重点把握底部板块的盈利和估值双升机会。同时，结构性的机会更多会出现在政府鼓励的成长方向，相信从中能走出主流增长板块，带动指数持续稳健的上升。

反思过去不足，积极面对未来。我们的策略是尽量规避通胀、衰退和外部影响的板块，板块贝塔行情可能演绎较充分并且在加速轮动，过于看重市场贝塔的波动会影响基金经理的主观判断和日常操作。作为风格偏向成长的专业投资选手，应该更注重攻守兼备的品种（即兼顾底部安全边际和股价弹性空间两个因素），把握真正能持续兑现成长属性和获得市场增长空间的股票。研究选股上，倾向于选择调整充分、能兑现业绩成长的板块加大研究力度，精选竞争格局好、成长估值匹配的个股加大配置，耐心把握年初可能出现的市场情绪回暖带动的反弹机会。

目前仍然看好：1.自主可控+专精特新，特别是在半导体材料设备和军工新材料、计算机自主可控等领域的投资机会，该领域需求不依赖于国际形势和宏观经济的变化，2.和经济复苏总量、政府政策积极支持相关的领域，计算机、传媒、电子、电动车都存在反弹机会，当然可能会适当偏向左侧投资，3.未来港股的互联网公司尽管反弹不少，但基本面仍在底部，反弹的空间取决于互联网公司在宏观经济恢复增长中的作用和地位，值得持续看好。此外，目前北交所整体估值水平更接近于原先新三板精选层的估值，距离创业板和科创板的估值差距仍然较大，所以如果科技创新的中小市值公司景气度好，北交所大概率也会持续受益，值得挖掘更多个股机会。

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

不适用。

§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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 27650 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	南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金(以下简称“南方创新精选一年定期开放混合发起式基金”)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。 (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，公允反映了南方创新精选一年定期开放混合发起式基金 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。

形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于南方创新精选一年定期开放混合发起式基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
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	南方创新精选一年定期开放混合发起式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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估南方创新精选一年定期开放混合发起式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创新精选一年定期开放混合发起式基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督南方创新精选一年定期开放混合发起式基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (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。 (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。 (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。 (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，就可能导致对南方创新精选一年定期开放混合发起式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创新精选一年定期开放混合发起式基金不能持续经营。 (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。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	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：南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金

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	71,442,223.56	88,744,892.08
结算备付金		979,339.99	4,958,589.31
存出保证金		336,766.29	955,779.60
交易性金融资产	7.4.7.2	809,085,891.76	1,360,987,977.97
其中：股票投资		807,180,460.75	1,360,987,977.97
基金投资		-	-
债券投资		1,905,431.01	-

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		-	5,094,260.76
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	18,471.72
资产总计		881,844,221.60	1,460,759,971.44
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		2,192,214.05	13,099,065.29
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,109,066.99	1,867,291.23
应付托管费		184,844.47	311,215.20
应付销售服务费		119,400.28	205,527.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13.89	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	930,172.85	3,091,571.16
负债合计		4,535,712.53	18,574,670.16
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	1,043,551,418.76	1,276,312,041.89
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-166,242,909.69	165,873,259.39
净资产合计		877,308,509.07	1,442,185,301.28
负债和净资产总计		881,844,221.60	1,460,759,971.44

注：报告截止日2022年12月31日，南方创新精选一年定开混合发起A份额净值0.8440元，基金份额总额759,707,349.83份；南方创新精选一年定开混合发起C份额净值0.8317元，基金份额总额283,844,068.93份；总份额合计1,043,551,418.76份。

7.2 利润表

会计主体：南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金

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		-324,433,222.55	179,576,278.61
1.利息收入		450,932.17	1,173,771.53
其中：存款利息收入	7.4.7.9	450,932.17	946,375.01
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		-	227,396.52
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-210,317,556.20	318,190,510.48
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-219,513,429.43	307,964,525.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	260,241.36	-10,203.03
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	8,935,631.87	10,236,188.41
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	-114,566,712.62	-139,790,251.13
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	114.10	2,247.73

减：二、营业总支出		20,749,434.13	70,139,425.84
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	16,066,388.50	33,096,404.48
2.托管费	7.4.10.2.2	2,677,731.39	5,516,067.33
3.销售服务费	7.4.10.2.3	1,753,776.87	3,819,701.57
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		2.46	-
8.其他费用	7.4.7.17	251,534.91	27,707,252.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-345,182,656.68	109,436,852.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-345,182,656.68	109,436,852.77
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-345,182,656.68	109,436,852.77

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金

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）	1,276,312,041.89	-	165,873,259.39	1,442,185,301.28
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）	1,276,312,041.89	-	165,873,259.39	1,442,185,301.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-232,760,623.13	-	-332,116,169.08	-564,876,792.21
（一）、综合收益总额	-	-	-345,182,656.68	-345,182,656.68
（二）、本期基金份额交易产生的	-232,760,623.13	-	13,066,487.60	-219,694,135.53

基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	1,449,119.94	-	-84,848.63	1,364,271.31
2.基金赎回款	-234,209,743.07	-	13,151,336.23	-221,058,406.84
（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）	1,043,551,418.76	-	-166,242,909.69	877,308,509.07
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）	2,484,955,206.53	-	262,058,071.99	2,747,013,278.52
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）	2,484,955,206.53	-	262,058,071.99	2,747,013,278.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,208,643,164.64	-	-96,184,812.60	-1,304,827,977.24
（一）、综合收益总额	-	-	109,436,852.77	109,436,852.77
（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）	-1,208,643,164.64	-	-205,621,665.37	-1,414,264,830.01
其中：1.基金申购款	36,943,849.58	-	4,545,069.60	41,488,919.18
2.基金赎回款	-1,245,587,014.22	-	-210,166,734.97	-1,455,753,749.19
（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）	1,276,312,041.89	-	165,873,259.39	1,442,185,301.28

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

南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金(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[2020]1023 号《关于准予南方创新精选一年定期开放混合型发起式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《南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,484,676,218.58 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(2020)第 0625 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,484,955,206.53 份，其中认购资金利息折合 278,987.95 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》和《南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金自基金合同生效后，每年开放一次申购和赎回。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用，但不从本类别基金资产净值中计提销售服务

费的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产净值中计提销售服务费，且不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票以及存托凭证)、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(以下简称“港股通股票”)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权)以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为：封闭期内，本基金股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例范围为60%-100%(其中港股通股票最高投资比例不得超过股票资产的50%)。应开放期流动性需要，为保护持有人利益，本基金开放期开始前1个月以及开放期结束后1个月内，本基金的股票资产投资比例可不受上述限制。开放期内，本基金股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例范围为0%-95%(其中港股通股票最高投资比例不得超过股票资产的50%)。开放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×45%+中国战略新兴产业成份指数收益率×15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+中债总指数收益率×30%。

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》、《南方创新精选一年定期开放混合型发起式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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金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。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

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

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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)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、应收利息和应收证券清算款，金额分别为88,744,892.08元、4,958,589.31元、955,779.60元、18,471.72元和5,094,260.76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、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为88,759,209.04元、4,962,259.58元、956,264.09元、0.00元和5,094,260.76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1,360,987,977.97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1,360,987,977.97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、应付销售服务费和应付交易费用，金额分别为13,099,065.29元、1,867,291.23元、311,215.20元、205,527.28元和2,881,571.16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、应付销售服务费和其他负债-应付交易费用，金额分别为 13,099,065.29 元、1,867,291.23 元、311,215.20 元、205,527.28 元和 2,881,571.16 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	71,442,223.56	88,744,892.08
等于：本金	71,434,576.17	88,744,892.08
加：应计利息	7,647.39	-
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	71,442,223.56	88,744,892.08

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		795,901,413.12	-	807,180,460.75	11,279,047.63
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,558,000.00	464.41	1,905,431.01	346,966.60
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,558,000.00	464.41	1,905,431.01	346,966.60
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		797,459,413.12	464.41	809,085,891.76	11,626,014.23
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		1,234,795,251.12	-	1,360,987,977.97	126,192,726.85
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		1,234,795,251.12	-	1,360,987,977.97	126,192,726.85

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	-	18,471.72
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	18,471.72

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	729,172.85	2,881,571.16
其中：交易所市场	729,172.85	2,881,571.16
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	201,000.00	210,000.00
其他	-	-
合计	930,172.85	3,091,571.16

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方创新精选一年定开混合发起 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	922,959,970.38	922,959,970.38
本期申购	985,301.37	985,301.37
本期赎回（以“-”号填列）	-164,237,921.92	-164,237,921.92
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	759,707,349.83	759,707,349.83

南方创新精选一年定开混合发起 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	353,352,071.51	353,352,071.51
本期申购	463,818.57	463,818.57
本期赎回（以“-”号填列）	-69,971,821.15	-69,971,821.15
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	283,844,068.93	283,844,068.93

注：

1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 根据《南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》和《南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金自基金合同生效后，每年开放一次申购和赎回，每个开放期的起始日为基金合同生效日的年度对日(如该日为非工作日或无对应日期，则顺延至下一工作日)，开放期不少于 5 个工作日并且最长不超过 20 个工作日。开放期内，投资人可以根据相关业务规则申购、赎回基金份额。本基金首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日(不含该日)之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

南方创新精选一年定开混合发起 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	122,206,887.20	252,492.42	122,459,379.62
本期利润	-166,166,698.72	-83,402,318.78	-249,569,017.50
本期基金份额交易产生的变动数	2,978,332.07	5,654,141.16	8,632,473.23
其中：基金申购款	-16,437.18	-38,247.61	-54,684.79
基金赎回款	2,994,769.25	5,692,388.77	8,687,158.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-40,981,479.45	-77,495,685.20	-118,477,164.65

南方创新精选一年定开混合发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	43,173,128.36	240,751.41	43,413,879.77
本期利润	-64,449,245.34	-31,164,393.84	-95,613,639.18
本期基金份额交易产生的变动数	2,085,829.88	2,348,184.49	4,434,014.37
其中：基金申购款	-13,622.94	-16,540.90	-30,163.84
基金赎回款	2,099,452.82	2,364,725.39	4,464,178.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-19,190,287.10	-28,575,457.94	-47,765,745.04

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	368,634.30	643,208.30
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	71,408.73	272,097.89
其他	10,889.14	31,068.82
合计	450,932.17	946,375.01

7.4.7.10 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	3,233,781,941.73	9,082,081,468.61
减：卖出股票成本总额	3,443,266,136.89	8,774,116,943.51
减：交易费用	10,029,234.27	-
买卖股票差价收入	-219,513,429.43	307,964,525.10

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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	671.17	-
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	259,570.19	-10,203.03
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	260,241.36	-10,203.03

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	1,198,302.96	1,053,942.27
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	938,500.00	1,060,377.54
减：应计利息总额	227.14	3,767.76
减：交易费用	5.63	-
买卖债券差价收入	259,570.19	-10,203.03

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 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.13 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	8,935,631.87	10,236,188.41
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	8,935,631.87	10,236,188.41

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	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
1.交易性金融资产	-114,566,712.62	-139,790,251.13
——股票投资	-114,913,679.22	-139,790,251.13
——债券投资	346,966.60	-
——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	-114,566,712.62	-139,790,251.13

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	114.10	1,920.25
基金转换费收入	-	327.48
合计	114.10	2,247.73

注：

1.本基金的赎回费率按持有期间递减，A 类份额赎回费归入基金财产的比例不得低于 50%；C 类基金份额赎回费全额归入基金资产。

2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 50%归入转出基金的基金资产。

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	81,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	29,277.43	45,327.99
其他	3,257.48	-
交易费用	-	27,433,924.47
合计	251,534.91	27,707,252.46

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、登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
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 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	576,698,767.17	9.27%	1,191,233,749.07	7.09%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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	509,886.57	9.02%	204,451.14	28.04%
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	978,780.10	6.47%	152,265.21	5.28%

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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	16,066,388.50	33,096,404.48
其中：支付销售机构的客户维护费	4,579,337.45	10,640,338.48

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 1.50%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 X1.50%/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	2,677,731.39	5,516,067.33

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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：日托管费＝前一日基金资产净值 X0.25%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方创新精选一年定开混合发起 A	南方创新精选一年定开混合发起 C	合计

华泰证券	-	197,369.72	197,369.72
南方基金	-	393,353.68	393,353.68
兴业证券	-	42,434.34	42,434.34
招商银行	-	106,612.17	106,612.17
合计	-	739,769.91	739,769.91
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方创新精选一年定开混合发起 A	南方创新精选一年定开混合发起 C	合计
华泰证券	-	390,992.25	390,992.25
南方基金	-	902,467.36	902,467.36
兴业证券	-	93,175.21	93,175.21
招商银行	-	246,959.43	246,959.43
合计	-	1,633,594.25	1,633,594.25

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X0.60%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	南方创新精选一年定开混合发起 A	南方创新精选一年定开混合发起 C

报告期初持有的基金份额	10,001,416.80	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,416.80	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.96%	-

项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	南方创新精选一年定开混合发起 A	南方创新精选一年定开混合发起 C
报告期初持有的基金份额	10,001,416.80	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,416.80	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.78%	-

基金管理人南方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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
招商银行	71,442,223.56	368,634.30	88,744,892.08	643,208.30

注：本基金由基金托管人招商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	301327	华宝新能	网下申购	2,417	574,037.50
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	6,790	548,632.00

华泰联合	301195	北路智控	网下申购	3,300	234,861.00
华泰联合	688420	美腾科技	网下申购	2,408	117,895.68
华泰联合	301316	慧博云通	网下申购	3,584	27,238.40
华泰联合	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
兴业证券	301165	锐捷网络	网下申购	10,769	348,700.22

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	600941	中国移动	网下申购	124,803	7,186,156.74
华泰联合	601728	中国电信	网下申购	562,873	2,549,814.69
华泰联合	688192	迪哲医药	网下申购	8,926	469,329.08
华泰联合	688105	诺 唯 赞	网下申购	6,180	339,900.00
华泰联合	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
华泰联合	688633	星球石墨	网下申购	1,558	52,379.96
华泰联合	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合	688260	昀冢科技	网下申购	2,990	28,793.70
华泰联合	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合	301033	迈普医学	网下申购	1,076	16,290.64
兴业证券	300941	创识科技	网下申购	3,989	85,005.59
兴业证券	688639	华恒生物	网下申购	2,302	53,314.32
兴业证券	688597	煜邦电力	网下申购	3,907	22,973.16

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	6 个月	新股锁定期	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-

		28 日								
301165	锐捷网络	2022 年 11 月 14 日	6 个月	新股锁定期	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-
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	-
301230	泓博医药	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股锁定期	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301267	华厦眼科	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股锁定期	50.88	66.20	754	38,363.52	49,914.80	-
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	-
301280	珠城科技	2022 年 12 月 19 日	6 个月	新股锁定期	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
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	-
301309	万得凯	2022 年 9 月 8 日	6 个月	新股锁定期	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
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 年 9 月 22 日	6 个月	新股锁定期	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301327	华宝新能	2022 年 9 月 8 日	6 个月	新股锁定期	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301363	美好医疗	2022	6 个月	新股锁	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-

		年 9 月 28 日		定期						
301365	矩阵股份	2022 年 11 月 14 日	6 个月	新股锁定期	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92	-
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	-
301377	鼎泰高科	2022 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定期	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
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	-
688143	长盈通	2022 年 12 月 1 日	6 个月	新股锁定期	35.67	42.66	1,938	69,128.46	82,675.08	-
688152	麒麟信安	2022 年 10 月 18 日	6 个月	新股锁定期	68.89	130.72	1,189	81,910.21	155,426.08	-
688271	联影医疗	2022 年 8 月 12 日	6 个月	新股锁定期	109.88	171.68	6,039	663,565.32	1,036,775.52	-
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，锁定期限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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，预期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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招商银行，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，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.22%(上年度末：本基金无债券投资)。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《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、流通受限制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 0.20%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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、存出保证金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	71,442,223.56	-	-	-	71,442,223.56
结算备付金	979,339.99	-	-	-	979,339.99
存出保证金	336,766.29	-	-	-	336,766.29
交易性金融资产	-	-	1,905,431.01	807,180,460.75	809,085,891.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	72,758,329.84	-	1,905,431.01	807,180,460.75	881,844,221.60
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	-	-	-	2,192,214.05	2,192,214.05
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	1,109,066.99	1,109,066.99
应付托管费	-	-	-	184,844.47	184,844.47
应付销售服务费	-	-	-	119,400.28	119,400.28
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	13.89	13.89
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	930,172.85	930,172.85
负债总计	-	-	-	4,535,712.53	4,535,712.53
利率敏感度缺口	72,758,329.84	-	1,905,431.01	802,644,748.22	877,308,509.07
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	88,744,892.08	-	-	-	88,744,892.08
结算备付金	4,958,589.31	-	-	-	4,958,589.31
存出保证金	955,779.60	-	-	-	955,779.60
交易性金融资产	-	-	-	1,360,987,977.97	1,360,987,977.97
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	-	-	-	5,094,260.76	5,094,260.76
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	18,471.72	18,471.72
资产总计	94,659,260.99	-	-	1,366,100,710.45	1,460,759,971.44
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	-	-	-	13,099,065.29	13,099,065.29
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,867,291.23	1,867,291.23
应付托管费	-	-	-	311,215.20	311,215.20
应付销售服务费	-	-	-	205,527.28	205,527.28
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	-	-	-	3,091,571.16	3,091,571.16
负债总计	-	-	-	18,574,670.16	18,574,670.16
利率敏感度缺口	94,659,260.99	-	-	1,347,526,040.29	1,442,185,301.28

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	-27,481.37	0.00
	2.市场利率平行下降 25 个基点	27,957.63	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	-	117,400,928.96	-	-	-	117,400,928.96
资产合计	-	117,400,928.96	-	-	-	117,400,928.96
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	-	117,400,928.96	-	-	-	117,400,928.96

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	-	16,873,399.87	-	-	-	16,873,399.87
资产合计	-	16,873,399.87	-	-	-	16,873,399.87
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	-	16,873,399.87	-	-	-	16,873,399.87

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	上年度末（ 2021 年 12

		月 31 日 ）	月 31 日 ）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	5,870,046.45	843,669.99
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-5,870,046.45	-843,669.99

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：封闭期内，股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例范围为60%-100%(其中港股通股票最高投资比例不得超过股票资产的 50%)；开放期内，股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例范围为0%-95%(其中港股通股票最高投资比例不得超过股票资产的 50%)。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，包括 VaR(ValueatRisk)指标等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	807,180,460.75	92.01	1,360,987,977.97	94.37
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	807,180,460.75	92.01	1,360,987,977.97	94.37

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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.沪深 300 上升 5%	39,835,677.63	70,143,811.43
	2.沪深 300 下降 5%	-39,835,677.63	-70,143,811.43

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	807,371,792.40	1,351,283,949.53
第二层次	-	7,188,092.74
第三层次	1,714,099.36	2,515,935.70
合计	809,085,891.76	1,360,987,977.97

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	
	交易性金融资产	合计

	债券投资	股票	
期初余额	-	2,515,935.70	2,515,935.70
当期购买	-	2,000,034.40	2,000,034.40
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	7,382,879.00	7,382,879.00
转出第三层次	-	10,791,698.44	10,791,698.44
当期利得或损失总额	-	606,948.70	606,948.70
其中：计入损益的利得或损失	-	606,948.70	606,948.70
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,714,099.36	1,714,099.36
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	-	466,130.55	466,130.55
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	-	2,422,913.25	2,422,913.25
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	-	93,022.45	93,022.45
其中：计入损益的利得或损失	-	93,022.45	93,022.45
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,515,935.70	2,515,935.70
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	-	93,022.45	93,022.45

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	1,714,099.36	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2127~2.4756	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	2,515,935.70	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1717~1.4663	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

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	807,180,460.75	91.53
	其中：股票	807,180,460.75	91.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,905,431.01	0.22
	其中：债券	1,905,431.01	0.22
	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	72,421,563.55	8.21

8	其他资产	336,766.29	0.04
9	合计	881,844,221.60	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股市值为人民币117,400,928.96元，占基金资产净值比例13.38%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,773,641.00	0.32
B	采矿业	1,276,860.80	0.15
C	制造业	541,325,144.60	61.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,677.03	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	382,888.04	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	3,979,510.50	0.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	120,886,100.46	13.78
J	金融业	2,231,384.83	0.25
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,406,008.33	0.39
M	科学研究和技术服务业	12,775,041.88	1.46
N	水利、环境和公共设施管理业	152,308.17	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	545,966.15	0.06
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	689,779,531.79	78.62

8.2.2 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	1,910,168.57	0.22
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费	3,601,117.96	0.41
必需消费品	4,676,268.45	0.53
医疗保健	1,800,832.32	0.21
金融	28,253,558.41	3.22

科技	-	-
通讯	77,158,983.25	8.79
公用事业	-	-
房地产	-	-
政府	-	-
合计	117,400,928.96	13.38

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

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	688232	新点软件	1,060,972	60,539,062.32	6.90
2	603606	东方电缆	711,600	48,267,828.00	5.50
3	00700	腾讯控股	158,400	47,258,985.31	5.39
4	600519	贵州茅台	20,640	35,645,280.00	4.06
5	300699	光威复材	489,700	35,380,825.00	4.03
6	300316	晶盛机电	531,500	33,782,140.00	3.85
7	600765	中航重机	1,051,800	32,700,462.00	3.73
8	03690	美团-W	191,600	29,899,997.94	3.41
9	00388	香港交易所	93,800	28,253,558.41	3.22
10	300438	鹏辉能源	336,200	26,220,238.00	2.99
11	002594	比亚迪	95,700	24,592,029.00	2.80
12	688066	航天宏图	285,628	24,421,194.00	2.78
13	002318	久立特材	1,463,500	24,352,640.00	2.78
14	835185	贝特瑞	574,081	23,898,992.03	2.72
15	002049	紫光国微	175,259	23,102,641.3	2.63

				8	
16	300896	爱美客	33,600	19,029,360.00	2.17
17	603279	景津装备	609,374	17,964,345.52	2.05
18	688122	西部超导	186,145	17,626,070.05	2.01
19	688333	铂力特	113,126	16,148,736.50	1.84
20	300687	赛意信息	545,000	16,077,500.00	1.83
21	835368	连城数控	286,738	14,847,293.64	1.69
22	688131	皓元医药	113,229	12,271,759.02	1.40
23	300593	新雷能	278,240	11,819,635.20	1.35
24	301153	中科江南	99,961	10,639,848.84	1.21
25	002179	中航光电	181,680	10,493,836.80	1.20
26	000733	振华科技	88,400	10,097,932.00	1.15
27	300820	英杰电气	131,800	9,684,664.00	1.10
28	688008	澜起科技	153,528	9,610,852.80	1.10
29	000063	中兴通讯	349,500	9,038,070.00	1.03
30	002180	纳思达	125,300	6,501,817.00	0.74
31	600050	中国联通	1,242,700	5,567,296.00	0.63
32	300014	亿纬锂能	59,200	5,203,680.00	0.59
33	872925	锦好医疗	300,008	4,350,116.00	0.50
34	603008	喜临门	151,900	4,336,745.00	0.49
35	603871	嘉友国际	174,900	3,952,740.00	0.45
36	836239	长虹能源	159,908	3,657,095.96	0.42
37	09992	泡泡玛特	203,400	3,601,117.96	0.41
38	002531	天顺风能	236,100	3,572,193.00	0.41
39	00168	青岛啤酒股份	50,000	3,443,555.85	0.39
40	600057	厦门象屿	329,800	3,387,046.00	0.39
41	600522	中天科技	209,659	3,385,992.85	0.39
42	688599	天合光能	52,878	3,371,501.28	0.38
43	833533	骏创科技	200,357	3,297,876.22	0.38
44	601865	福莱特	96,700	3,221,077.00	0.37
45	603324	盛剑环境	75,600	2,651,292.00	0.30

46	688533	上声电子	44,458	2,551,889.20	0.29
47	603171	税友股份	69,300	2,522,520.00	0.29
48	301063	海锅股份	73,900	2,514,078.00	0.29
49	600993	马应龙	109,000	2,463,400.00	0.28
50	601012	隆基绿能	56,240	2,376,702.40	0.27
51	301377	鼎泰高科	118,720	2,333,651.60	0.27
52	000776	广发证券	137,500	2,129,875.00	0.24
53	300395	菲利华	36,600	2,013,000.00	0.23
54	002714	牧原股份	39,500	1,925,625.00	0.22
55	03800	协鑫科技	1,080,000	1,910,168.57	0.22
56	000708	中信特钢	106,800	1,832,688.00	0.21
57	06078	海吉亚医疗	36,000	1,800,832.32	0.21
58	002311	海大集团	29,000	1,790,170.00	0.20
59	600660	福耀玻璃	50,200	1,760,514.00	0.20
60	300054	鼎龙股份	81,900	1,743,651.00	0.20
61	688598	金博股份	7,537	1,654,220.76	0.19
62	688348	昱能科技	2,861	1,626,478.50	0.19
63	601869	长飞光纤	46,000	1,500,980.00	0.17
64	688120	华海清科	6,517	1,463,392.35	0.17
65	603203	快克股份	45,300	1,335,897.00	0.15
66	600938	中国海油	84,004	1,276,860.80	0.15
67	300776	帝尔激光	9,800	1,234,800.00	0.14
68	01579	颐海国际	50,000	1,232,712.60	0.14
69	688271	联影医疗	6,039	1,036,775.52	0.12
70	836077	吉林碳谷	19,838	935,956.84	0.11
71	002459	晶澳科技	15,400	925,386.00	0.11
72	300498	温氏股份	43,200	848,016.00	0.10
73	301238	瑞泰新材	34,966	786,385.34	0.09
74	300041	回天新材	47,400	773,568.00	0.09
75	301095	广立微	7,399	656,853.37	0.07
76	002138	顺络电子	24,100	630,938.00	0.07
77	301267	华厦眼科	7,539	545,966.15	0.06
78	688283	坤恒顺维	9,269	537,694.69	0.06
79	605080	浙江自然	10,700	505,040.00	0.06
80	688560	明冠新材	10,839	501,845.70	0.06
81	688475	萤石网络	19,226	498,530.18	0.06
82	300623	捷捷微电	23,900	492,818.00	0.06
83	688141	杰华特	9,946	472,435.00	0.05
84	688503	聚和材料	2,498	372,476.78	0.04
85	000906	浙商中拓	40,900	368,509.00	0.04
86	301165	锐捷网络	10,769	364,638.09	0.04
87	688639	华恒生物	2,302	357,385.50	0.04
88	688192	迪哲医药	8,926	351,416.62	0.04

89	688658	悦康药业	16,580	320,325.60	0.04
90	301219	腾远钴业	4,466	307,841.38	0.04
91	688432	有研硅	20,044	265,382.56	0.03
92	301391	卡莱特	2,470	210,066.09	0.02
93	688489	三未信安	1,995	202,153.35	0.02
94	688179	阿拉丁	5,522	199,620.30	0.02
95	002884	凌霄泵业	11,000	182,710.00	0.02
96	301195	北路智控	2,300	171,262.20	0.02
97	839167	同享科技	12,930	168,865.80	0.02
98	688147	微导纳米	6,293	157,828.44	0.02
99	688152	麒麟信安	1,189	155,426.08	0.02
100	688084	晶品特装	1,875	155,025.00	0.02
101	301297	富乐德	10,147	150,256.17	0.02
102	688426	康为世纪	3,776	133,821.44	0.02
103	301280	珠城科技	2,783	132,065.20	0.02
104	301365	矩阵股份	5,160	129,624.36	0.01
105	301366	一博科技	2,672	124,831.72	0.01
106	688410	山外山	4,853	122,635.31	0.01
107	688376	美埃科技	3,713	116,142.64	0.01
108	301379	天山电子	4,481	114,278.07	0.01
109	688768	容知日新	907	102,454.72	0.01
110	688420	美腾科技	2,408	98,294.56	0.01
111	688370	丛麟科技	2,596	91,716.68	0.01
112	688252	天德钰	5,201	87,220.77	0.01
113	688143	长盈通	1,938	82,675.08	0.01
114	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.01
115	301006	迈拓股份	5,051	78,846.11	0.01
116	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
117	301388	欣灵电气	2,920	67,802.40	0.01
118	688662	富信科技	2,556	67,682.88	0.01
119	688718	唯赛勃	3,145	62,616.95	0.01
120	688480	赛恩斯	2,302	50,920.24	0.01
121	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
122	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
123	688117	圣诺生物	1,672	37,151.84	0.00
124	688109	品茗科技	1,301	36,818.30	0.00
125	001338	永顺泰	1,649	34,826.88	0.00
126	001258	立新能源	3,188	33,346.48	0.00
127	601022	宁波远洋	1,983	26,770.50	0.00
128	688092	爱科科技	1,137	26,401.14	0.00
129	001322	箭牌家居	1,595	24,244.00	0.00
130	001318	阳光乳业	1,142	21,926.40	0.00
131	001228	永泰运	383	18,962.33	0.00

132	001236	弘业期货	1,399	18,956.45	0.00
133	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
134	603235	天新药业	572	16,656.64	0.00
135	001298	好上好	403	14,379.04	0.00
136	603130	云中马	480	13,176.00	0.00
137	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
138	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.00
139	001333	光华股份	426	12,332.70	0.00
140	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
141	001300	三柏硕	763	11,826.50	0.00
142	001331	胜通能源	385	11,330.55	0.00
143	603151	邦基科技	535	11,256.40	0.00
144	001319	铭科精技	536	10,843.28	0.00
145	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
146	603097	江苏华辰	577	9,860.93	0.00
147	001230	劲旅环境	375	9,671.25	0.00
148	301196	唯科科技	271	9,100.18	0.00
149	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
150	001336	楚环科技	274	6,770.54	0.00
151	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
152	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
153	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
154	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	600519	贵州茅台	99,182,444.90	6.88
2	002594	比亚迪	89,622,391.01	6.21
3	300014	亿纬锂能	85,972,775.25	5.96
4	300750	宁德时代	85,357,807.76	5.92
5	300059	东方财富	84,843,265.12	5.88
6	002466	天齐锂业	83,926,907.73	5.82
7	601012	隆基绿能	67,332,360.96	4.67
8	603606	东方电缆	64,141,982.48	4.45
9	002371	北方华创	63,634,122.42	4.41
10	000776	广发证券	62,155,236.39	4.31
11	300015	爱尔眼科	60,687,591.21	4.21
12	002555	三七互娱	60,670,692.70	4.21

13	603259	药明康德	58,654,948.78	4.07
14	00700	腾讯控股	57,088,236.06	3.96
15	01024	快手－W	56,160,268.65	3.89
16	03690	美团－W	55,448,631.35	3.84
17	600765	中航重机	49,727,412.74	3.45
18	300896	爱美客	48,969,519.16	3.40
19	300438	鹏辉能源	46,090,757.13	3.20
20	002756	永兴材料	44,362,456.64	3.08
21	600522	中天科技	43,318,939.60	3.00
22	002415	海康威视	42,992,780.11	2.98
23	300699	光威复材	40,419,762.72	2.80
24	603501	韦尔股份	39,758,259.00	2.76
25	300316	晶盛机电	39,675,624.69	2.75
26	002460	赣锋锂业	39,394,209.40	2.73
27	09868	小鹏汽车－W	38,848,618.63	2.69
28	002714	牧原股份	35,340,725.75	2.45
29	603986	兆易创新	33,759,076.30	2.34
30	300033	同花顺	33,481,187.35	2.32
31	002405	四维图新	31,854,239.00	2.21
32	688122	西部超导	29,856,997.12	2.07
33	603806	福斯特	29,138,841.49	2.02
34	601919	中远海控	29,101,074.80	2.02
35	688598	金博股份	28,949,585.29	2.01

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	300750	宁德时代	153,922,579.82	10.67
2	000776	广发证券	119,630,476.05	8.30
3	601012	隆基绿能	110,848,544.58	7.69
4	002371	北方华创	96,594,214.87	6.70
5	002466	天齐锂业	94,745,907.43	6.57
6	002594	比亚迪	94,523,121.45	6.55
7	300408	三环集团	87,237,259.11	6.05
8	603501	韦尔股份	77,847,857.84	5.40
9	600522	中天科技	77,326,182.37	5.36
10	300014	亿纬锂能	77,037,411.13	5.34
11	600519	贵州茅台	76,982,698.05	5.34
12	300059	东方财富	75,929,373.60	5.26

13	300015	爱尔眼科	69,414,584.65	4.81
14	01024	快手－W	54,806,961.82	3.80
15	603259	药明康德	53,766,990.94	3.73
16	002049	紫光国微	52,572,663.91	3.65
17	600660	福耀玻璃	49,378,684.51	3.42
18	002555	三七互娱	47,898,621.11	3.32
19	600460	士兰微	43,959,125.46	3.05
20	002756	永兴材料	43,023,156.09	2.98
21	603606	东方电缆	41,311,212.73	2.86
22	002460	赣锋锂业	41,056,597.00	2.85
23	600845	宝信软件	40,435,204.91	2.80
24	002812	恩捷股份	39,962,830.37	2.77
25	603806	福斯特	37,281,204.72	2.59
26	002192	融捷股份	37,114,084.27	2.57
27	002415	海康威视	36,702,180.26	2.54
28	300438	鹏辉能源	36,598,588.25	2.54
29	002475	立讯精密	35,920,997.70	2.49
30	300896	爱美客	35,272,867.07	2.45
31	002459	晶澳科技	35,268,274.15	2.45
32	603986	兆易创新	34,581,255.49	2.40
33	600563	法拉电子	33,755,983.64	2.34
34	09868	小鹏汽车－W	33,678,191.04	2.34
35	002714	牧原股份	33,336,755.88	2.31
36	03690	美团－W	32,545,645.35	2.26
37	002405	四维图新	30,136,744.00	2.09
38	688598	金博股份	29,672,200.37	2.06
39	000792	盐湖股份	29,139,465.32	2.02

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	3,004,372,298.89
卖出股票收入（成交）总额	3,233,781,941.73

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,905,431.01	0.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,905,431.01	0.22

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	118027	宏图转债	15,580	1,905,431.01	0.22

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

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

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	336,766.29
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	336,766.29

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方创新精选一年定开混合发起 A	13,784	55,115.16	12,856,937.65	1.69%	746,850,412.18	98.31%
南方创新精选一年定开混合发起 C	14,702	19,306.49	750,106.24	0.26%	283,093,962.69	99.74%
合计	28,486	36,633.83	13,607,043.89	1.30%	1,029,944,374.87	98.70%

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方创新精选一年定开混合发起 A	148,838.03	0.0196%
	南方创新精选一年定开混合发起 C	1,028,369.48	0.3623%
	合计	1,177,207.51	0.1128%

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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。

9.4 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）
罗安安	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,416.80	0.96	10,000,000.00	0.96	自合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,416.80	0.96	10,000,000.00	0.96	-

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方创新精选一年定开混合发起 A	南方创新精选一年定开混合发起 C
基金合同生效日(2020 年 7 月 21 日)基金份额总额	1,752,692,946.75	732,262,259.78
本报告期期初基金份额总额	922,959,970.38	353,352,071.51
本报告期基金总申购份额	985,301.37	463,818.57
减：报告期基金总赎回份额	164,237,921.92	69,971,821.15
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	759,707,349.83	283,844,068.93

§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）。

自 2022 年 07 月 15 日起，孙乐女士担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

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 3 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 81,000.00 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	
广发证券	1	1,092,898,506.51	17.57%	998,991.92	17.67%	-
浙商证券	1	726,804,482.85	11.69%	657,975.34	11.64%	-
华泰证券	3	576,698,767.17	9.27%	509,886.57	9.02%	-
长江证券	1	544,323,379.28	8.75%	495,772.03	8.77%	-
中信建投	2	519,130,617.57	8.35%	471,866.94	8.35%	-
西藏东财	1	439,768,908.05	7.07%	401,404.94	7.10%	-
华西证券	3	422,149,103.91	6.79%	385,489.39	6.82%	-
东方证券	1	349,927,785.19	5.63%	319,118.69	5.64%	-
国元证券	1	264,725,278.68	4.26%	242,525.48	4.29%	-
财通证券	2	242,802,067.13	3.90%	223,532.86	3.95%	-
东北证券	1	236,598,284.39	3.80%	216,652.57	3.83%	-
招商证券	1	235,107,403.30	3.78%	212,347.92	3.76%	-
信达证券	1	165,375,136.83	2.66%	150,250.07	2.66%	-
海通证券	1	117,860,477.28	1.90%	108,585.08	1.92%	-
银河证券	1	77,417,051.92	1.24%	70,267.60	1.24%	-
安信证券	2	74,590,231.49	1.20%	67,240.24	1.19%	-
中银国际	1	66,448,404.63	1.07%	60,554.73	1.07%	-
华安证券	1	54,842,901.33	0.88%	50,311.30	0.89%	-
方正证券	1	11,939,066.11	0.19%	10,880.04	0.19%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
金圆统一证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	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：

中银国际

华安证券

华西证券

长江证券

财通证券

中金公司

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
广发证券	116,073.56	9.69%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
西藏东财	1,082,229.40	90.31%	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

信达证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
金圆统一证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金获配浙江鼎力（603338）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-06
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金获配川能动力（000155）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-17
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	2022-03-26
5	南方基金关于旗下部分基金增加宁波银行为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-20
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金增加侧袋机制并相应修订基金合同有关条款的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-19
7	南方基金关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-24
8	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
9	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	2022-05-28

		基金电子披露网站	
10	南方基金关于旗下部分基金增加联泰基金为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-31
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	2022-07-16
12	南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-18
13	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
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	2022-07-27
15	南方基金关于旗下部分基金增加中欧财富为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-08-17
16	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修改基金合同及托管协议的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-08-31
17	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-09
18	南方基金关于旗下部分基金增加东方证券为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-16
19	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
20	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	2022-11-16
21	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	2022-12-03
22	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
23	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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金的文件;

2、《南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》;

3、《南方创新精选一年定期开放混合型发起式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、《南方创新精选一年定期开放混合型发起式证券投资基金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