

中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:中融基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，上会会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2022年1月1日起至2022年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	28
§8 投资组合报告	61
8.1 期末基金资产组合情况	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	68
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	68
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	68
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	68
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68

8.12 投资组合报告附注.....	68
§9 基金份额持有人信息.....	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
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.....	71
§10 开放式基金份额变动.....	72
§11 重大事件揭示.....	72
11.1 基金份额持有人大会决议.....	72
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.....	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
11.4 基金投资策略的改变.....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	73
11.8 其他重大事件.....	75
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
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.....	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
§13 备查文件目录.....	77
13.1 备查文件目录.....	77
13.2 存放地点.....	77
13.3 查阅方式.....	77

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中融鑫价值混合	
基金主代码	004836	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年03月09日	
基金管理人	中融基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	61,311,903.02份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中融鑫价值混合A	中融鑫价值混合C
下属分级基金的交易代码	004836	004837
报告期末下属分级基金的份额总额	36,835,423.60份	24,476,479.42份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金持有人获取长期持续稳定的投资回报。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> 1. 大类资产配置 2. 股票投资策略 3. 债券投资策略 4. 中小企业私募债券投资策略 5. 衍生品投资策略 6. 资产支持证券投资策略
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+上证国债指数收益率×60%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

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	中融基金管理有限公司		交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周妹云	陆志俊
	联系电话	010-56517000	95559
	电子邮箱	zhoumeiyun@zrfunds.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话	400-160-6000; 010-56517299		95559
传真	010-56517001		021-62701216
注册地址	深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3202、3203B		中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址	北京市东城区安定门外大街208号中粮置地广场A座11层		中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	100102		200336
法定代表人	王瑶		任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zrfunds.com.cn/
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼
注册登记机构	中融基金管理有限公司	北京市东城区安定门外大街208号中粮置地广场A座11层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022年		2021年		2020年	
	中融鑫 价值混 合A	中融鑫 价值混 合C	中融鑫 价值混 合A	中融鑫 价值混 合C	中融鑫 价值混 合A	中融鑫 价值混 合C
本期已实现收益	-2,821,201.05	-1,550,073.34	6,563,580.66	4,097,457.30	3,372,810.67	3,923,887.62
本期利润	-10,044,952.78	-5,382,915.84	8,806,924.26	8,526,934.95	3,043,375.89	-1,563,613.25
加权平均基金份额 本期利润	-0.2359	-0.2060	0.1024	0.0989	0.1560	-0.0362
本期加权平均净值 利润率	-21.98%	-20.70%	8.77%	9.09%	14.64%	-3.55%
本期基金份额净值 增长率	-17.78%	-17.87%	9.59%	9.01%	9.11%	2.68%
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	486,013.61	-1,399,785.64	11,322,604.81	4,069,312.61	9,049,230.73	5,477,759.22
期末可供分配基金 份额利润	0.0132	-0.0572	0.2323	0.1479	0.1245	0.0530
期末基金资产净值	37,321,437.21	23,076,693.78	60,060,885.33	31,590,679.29	81,757,652.10	108,745,741.88
期末基金份额净值	1.0132	0.9428	1.2323	1.1479	1.1245	1.0530
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	1.32%	-5.72%	23.23%	14.79%	12.45%	5.30%

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

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

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

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

中融鑫价值混合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	-1.27%	0.42%	1.03%	0.51%	-2.30%	-0.09%
过去六个月	-7.65%	0.43%	-4.66%	0.44%	-2.99%	-0.01%
过去一年	-17.78%	0.82%	-6.88%	0.51%	-10.90%	0.31%
过去三年	-1.69%	1.12%	6.22%	0.52%	-7.91%	0.60%
自基金合同生效起至今	1.32%	1.03%	13.24%	0.52%	-11.92%	0.51%

中融鑫价值混合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	-1.30%	0.42%	1.03%	0.51%	-2.33%	-0.09%
过去六个月	-7.70%	0.43%	-4.66%	0.44%	-3.04%	-0.01%
过去一年	-17.87%	0.82%	-6.88%	0.51%	-10.99%	0.31%
过去三年	-8.06%	1.11%	6.22%	0.52%	-14.28%	0.59%
自基金合同生效起至今	-5.72%	1.02%	13.24%	0.52%	-18.96%	0.50%

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

中融鑫价值混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年03月09日-2022年12月31日)

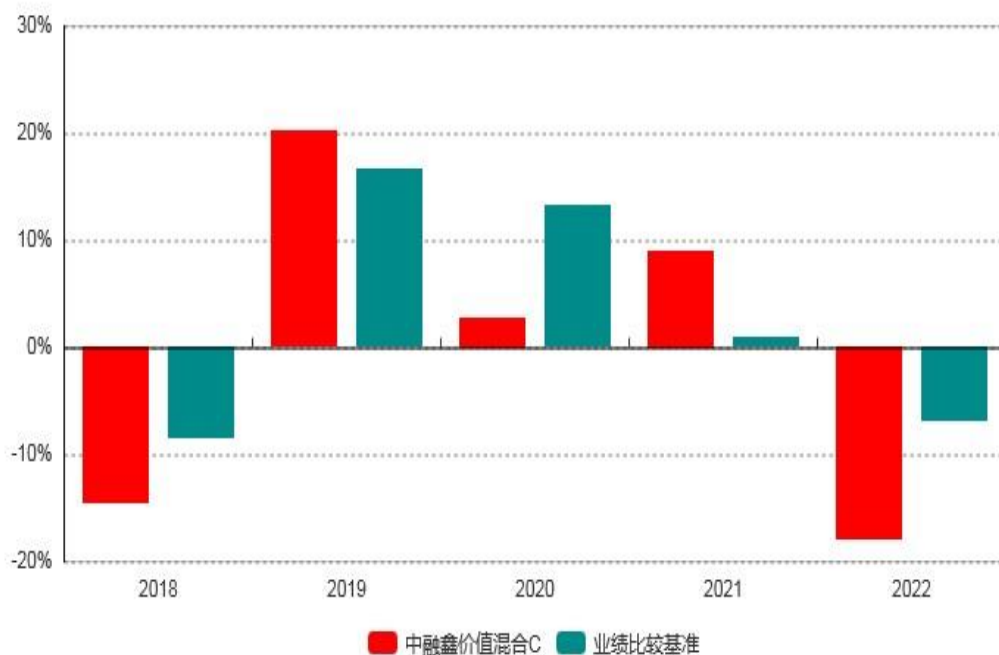
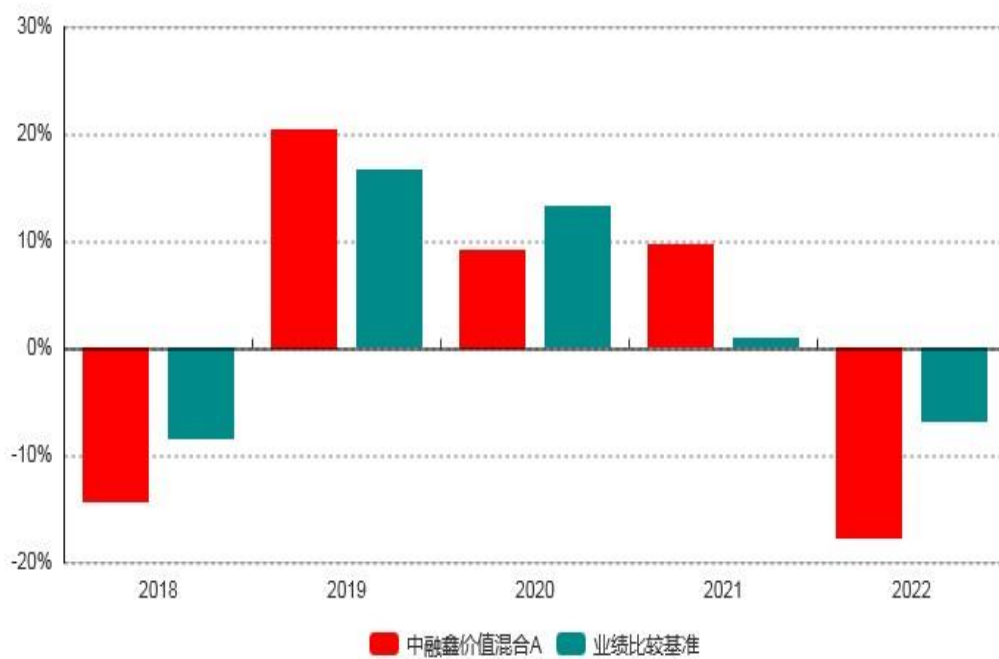


中融鑫价值混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年03月09日-2022年12月31日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

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



注：本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

注：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

本基金管理人为中融基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由中融国际信托有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2022年12月31日，中融基金管理有限公司共管理82只基金，包括中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数型证券投资基金、中融中证煤炭指数型证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融日日盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融盈泽中短债债券型证券投资基金、中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融睿祥纯债债券型证券投资基金、中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融量化精选混合型基金中基金（FOF）、中融医疗健康精选混合型证券投资基金、中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒惠纯债债券型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融策略优选混合型证券投资基金、中融恒鑫纯债债券型证券投资基金、中融聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融高股息精选混合型证券投资基金、中融睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融恒安纯债债券型证券投资基金、中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融品牌优选混合型证券投资基金、中融1-5年国开行债券指数证券投资基金、中融聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、中融价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金、中融成长优选混合型证券投资基金、中融景瑞一年持有期混合型证券投资

资基金、中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金、中融景颐6个月持有期混合型证券投资基金、中融行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、中融景盛一年持有期混合型证券投资基金、中融恒益纯债债券型证券投资基金、中融恒阳纯债债券型证券投资基金、中融低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、中融景泓一年持有期混合型证券投资基金、中融金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、中融匠心优选混合型证券投资基金、中融恒利纯债债券型证券投资基金、中融添益进取3个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、中融高质量成长混合型证券投资基金、中融景惠混合型证券投资基金、中融聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒泽纯债债券型证券投资基金、中融研发创新混合型证券投资基金、中融优势产业混合型证券投资基金、中融医药消费混合型证券投资基金、中融成长先锋一年持有期混合型证券投资基金、中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、中融益泓90天滚动持有债券型证券投资基金、中融兴鸿优选一年封闭运作混合型证券投资基金、中融恒通纯债债券型证券投资基金、中融融盛双盈一年封闭运作债券型证券投资基金、中融养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、中融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、中融恒润纯债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴刚	中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、中融金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。	2020-03-05	-	11	吴刚先生，中国国籍，毕业于大连理工大学管理科学与工程专业，香港中文大学哲学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限11年。2011年1月至2013年6月曾于方正证券股份有限公司担任高级研究员；2013年6月至2016年10月曾任兴业基金管理有限公司投资经

					理、股权业务负责人，2016年10月加入中融基金管理有限公司，现任成长投资部基金经理。
潘巍	中融盈泽中短债债券型证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融融盛双盈一年封闭运作债券型证券投资基金、中融益泓90天滚动持有债券型证券投资基金、中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理及绝对收益部总经理	2022-07-18	-	13	潘巍先生，中国国籍，毕业于美国哥伦比亚大学运筹学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限13年。2009年6月至2013年9月曾任中信证券股份有限公司资产管理部股票研究员、债券研究员；2013年9月至2015年8月曾任中华联合保险控股股份有限公司资产管理中心投资经理；2015年8月至2016年11月曾任华夏基金管理有限公司机构债券投资部投资经理；2016年12月至2022年3月曾任安信基金管理有限责任公司固定收益部投资经理、基金经理。2022年3月加入中融基金管理有限公司，现任绝对收益部总经理。
陈荔	中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。	2020-08-26	2022-07-07	7	陈荔女士，中国国籍，毕业于罗彻斯特大学金融学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限7年。2015年7月至2016年5月任中国中投证券有限责任公司研究总部助理研究员；2016年5月加入中融基金管理有限公司

					司，现任成长投资部基金经理。
王可汗	中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、中融成长优选混合型证券投资基金的基金经理。	2021-03-12	2022-07-07	6	王可汗先生，中国国籍，毕业于美国德克萨斯大学达拉斯分校会计学、金融学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限6年。2016年4月加入中融基金管理有限公司，现任成长投资部基金经理。

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券基金从业的含义遵从《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》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理办法》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理办法要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组

合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行，公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内未出现涉及本基金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5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年是富有挑战的一年，无论股票还是债券，都经历了较大的波折，对于灵活配置型混合产品是一次较大的考验。回顾2022年，本产品在上半年由于权益仓位较高，经历了一定幅度的回撤，下半年之后对投资策略有所改进，在追寻市场机会的同时重视对回撤的控制。整体而言，从2022年下半年起产品净值的波动幅度有所降低。

作为股债混合型产品，我们希望能够发挥股债混合投资的优势，尽可能打造出相对稳健的风险收益特征。简单而言，我们努力的方向是让产品的长期业绩达到或超越同类型产品的中枢水平，但波动率能够优于同类型产品（如较低的回撤、较高的夏普比率），从而让不同时间段进入的投资者，都能提升长期持有的体验。

我们对资本市场的长期前景充满期待。长期盈利的基础在于持续不断的现金流输入，固收类来源于票息资产，权益类来源于企业的盈利和增长。在世界范围内，中国经济依然维持着较高的增长速度，上市公司是国内优秀企业的代表，具有持续的内生增长动力，随着时间将会不断兑现。虽然市场价格难免有起伏波动，但价格并不会长期偏离价值，内在价值在足够长的时间内总会得到体现，最终带来投资的复利增长。

作为股债混合型产品，资产配置是组合运作的核心，对品类和时点选择的重要性要胜于对个股或个券的选择。我们希望从全局出发，站在尽可能高的角度，拓宽关注的领

域，遵照宏观基本面分析，综合考虑不同类资产的运行逻辑和配置价值，从中长期维度来配置各类资产，通过相对科学的组合管理，以实现我们对产品设定的风险收益目标。

另一方面，规避风险是长期投资盈利的基础，低回撤是长期复利增长的重要组成部分。我们会实施相对严苛的风控措施，尽可能降低市场冲击带来的波动，从而在出现机会时更加宽裕和从容。行稳方能致远，走得慢一点是为了更好地达到长期的投资目标，积小流以成江海，积跬步以至千里。我们希望做大概率正确的事，积极寻找长期的确定性，理性应对短期的不确定性，以相对稳健的方式，进行有规划的仓位管理、有预判的品类选择，在市场贪婪时多一分沉稳，在市场低落时多一分坚持。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融鑫价值混合A基金份额净值为1.0132元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-17.78%，同期业绩比较基准收益率为-6.88%；截至报告期末中融鑫价值混合C基金份额净值为0.9428元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-17.87%，同期业绩比较基准收益率为-6.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年有望进入信用扩张周期，经济具有较强的修复动能，而在恢复初期资金面通常也比较友好，权益类资产的估值和业绩有双升的可能性。对于债券类资产，利率债可能受困于经济恢复的进程面临一定的压力，但信用债在经历去年底调整之后的票息水平依然较高，利差也处于高位，中短久期品种具有较高的安全垫。风雨之后，方现彩虹，过去的跌宕起伏，为未来提供了更加多元的机会和更为广阔的空间，感谢每一位投资者的支持和陪伴。

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，本基金管理人在内部监察稽核工作中，一切从合规运作、保障基金份额持有人的利益出发，由督察长领导法律合规部及风险管理部对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，推动公司内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议，并跟踪改进落实情况。本报告期内，公司内部控制体系运行顺利，本基金运作没有出现违法违规行为。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

- 1、根据基金监管法律法规的最新变化，推动公司各部门及时完善与更新制度规范和业务流程，制定、颁布和更新了一系列公司基本管理制度，确保内控制度的适时性、全面性和合法合规性，并加强内部督导，将风险意识贯穿于各岗位与各业务环节。

2、日常监察和专项监察相结合，通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法，加强了对基金日常业务的合规审核和合规监测，并加强了对重要业务和关键业务环节的监督检查。

3、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性。公司在基金募集和持续营销活动中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

4、规范基金投资业务，保证投资管理工作规范有序、合法合规进行。公司制定了严格规范的投资管理制度和流程机制，以投资决策委员会为最高投资决策机构，投资业务均按照管理制度和业务流程执行。

5、以外聘律师、讲座等多种方式加强合规教育与培训，促进公司合规文化的建设，及时向公司传达基金相关的法律法规；加大了对员工行为的监察稽核力度，从源头上防范合规风险，防范利益输送行为。公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。我们将继续以风险控制为核心，进一步提高内部监察工作的科学性和有效性，切实保障基金的规范运作，充分保障基金份额持有人的利益。

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及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、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。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§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

2022年度，基金托管人在中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2022年度，中融基金管理有限公司在中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金的基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2022年度，由中融基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字（2023）第1788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	中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金全体份额持有人
审计意见	我们审计了中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中融鑫价值混合”)财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及相关财务

	<p>报表附注。我们认为，后附中融鑫价值混合的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了中融鑫价值混合2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中融鑫价值混合，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系中融鑫价值混合管理人(以下简称“管理人”)根据《中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定为其基金份额持有人编制的，因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供中融鑫价值混合份额持有人和向中国证券投资基金业协会及其派出机构报送使用，不得用于其他目的。</p>
其他信息	<p>管理人对其他信息负责。其他信息包括中融鑫价值混合2022年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在</p>

	<p>审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理人负责评估中融鑫价值混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</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总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。2、了解与审计相关的内部控制，以设计恰</p>

	<p>当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。3、评价管理人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。4、对管理人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，就可能导致对中融鑫价值混合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中融鑫价值混合不能持续经营。5、评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与管理人就中融鑫价值混合的审计范围、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	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	胡治华	江嘉炜
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼	
审计报告日期	2023-03-23	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	184,057.33	4,111,954.91

结算备付金		1,023,413.75	380,296.45
存出保证金		15,931.53	139,602.39
交易性金融资产	7.4.7.2	77,486,190.88	86,845,025.91
其中：股票投资		22,823,082.52	78,871,401.21
基金投资		-	-
债券投资		54,663,108.36	7,973,624.70
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	-144.66	-
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		928,637.05	71,493.59
应收股利		-	-
应收申购款		4,263.49	1,341,158.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	85,805.46
资产总计		79,642,349.37	92,975,337.53
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		18,040,652.97	-
应付清算款		1,012,550.39	-
应付赎回款		28,572.21	1,112,752.26
应付管理人报酬		30,910.75	50,454.53
应付托管费		5,151.81	8,409.06
应付销售服务费		1,963.90	3,127.46
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,901.19	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	120,515.16	149,029.60
负债合计		19,244,218.38	1,323,772.91
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	61,311,903.02	76,259,647.20
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-913,772.03	15,391,917.42
净资产合计		60,398,130.99	91,651,564.62
负债和净资产总计		79,642,349.37	92,975,337.53

注：(1) 报告截止日2022年12月31日，基金份额总额61,311,903.02份，其中A类基金份额的份额总额为36,835,423.60份，份额净值1.0132元；C类基金份额的份额总额为24,476,479.42份，份额净值0.9428元。

(2) 以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在2022年年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在2022年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2 021年12月31日
一、营业总收入		-14,641,977.72	20,903,631.62
1.利息收入		43,373.52	403,780.72
其中：存款利息收入	7.4.7.9	41,647.89	153,840.37
债券利息收入		-	249,940.35
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		1,725.63	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,859,669.36	12,181,577.50
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-5,790,681.59	6,463,526.20
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	813,861.12	2,508,086.72
资产支持证券投资收 益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,117,151.11	3,209,964.58
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）	7.4.7.17	-11,056,594.23	6,672,821.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	7.4.7.18	230,912.35	1,645,452.15
减：二、营业总支出		785,890.90	3,569,772.41

1. 管理人报酬		433,428.35	1,168,660.42
2. 托管费		72,238.14	194,776.64
3. 销售服务费		26,172.24	94,330.46
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		134,600.07	-
其中：卖出回购金融资产支出		134,600.07	-
6. 信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		1,275.44	0.78
8. 其他费用	7.4.7.20	118,176.66	2,112,004.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-15,427,868.62	17,333,859.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-15,427,868.62	17,333,859.21
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-15,427,868.62	17,333,859.21

注：以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在2022年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022年01月01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	76,259,647.20	-	15,391,917.42	91,651,564.62

值)				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	76,259,647.20	-	15,391,917.42	91,651,564.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-14,947,744.18	-	-16,305,689.45	-31,253,433.63
（一）、综合收益总额	-	-	-15,427,868.62	-15,427,868.62
（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）	-14,947,744.18	-	-877,820.83	-15,825,565.01
其中：1.基金申购款	46,479,410.17	-	3,142,307.33	49,621,717.50
2.基金赎回款	-61,427,154.35	-	-4,020,128.16	-65,447,282.51
（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	61,311,903.02	-	-913,772.03	60,398,130.99

资产（基金净值）				
项目	上年度可比期间 2021年01月01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）	175,976,404.03	-	14,526,989.95	190,503,393.98
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）	175,976,404.03	-	14,526,989.95	190,503,393.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-99,716,756.83	-	864,927.47	-98,851,829.36
（一）、综合收益总额	-	-	17,333,859.21	17,333,859.21
（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）	-99,716,756.83	-	-16,468,931.74	-116,185,688.57
其中：1.基金申购款	403,879,591.85	-	57,940,507.92	461,820,099.77
2.基金赎回款	-503,596,348.68	-	-74,409,439.66	-578,005,788.34
（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)	76,259,647.20	-	15,391,917.42	91,651,564.62

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:

王瑶

黄庆

李克

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

中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金(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[2017]852号《关于准予中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由基金发起人中融基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2018年3月9日募集成立。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。本基金募集期为自2017年12月4日至2018年3月2日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,本基金共募集有效净认购资金203,687,534.87元,折合203,687,534.87份中融鑫价值混合基金份额(其中:A类基金份额为2,663,814.09份;C类基金份额为201,023,720.78份)。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币39,782.94元,折合39,782.94份中融鑫价值混合基金份额(其中:A类基金份额为5,361.34份;C类基金份额为34,421.60份),以上收到的实收基金共计人民币203,727,317.81元,折合203,727,317.81份中融鑫价值混合基金份额(其中:A类基金份额为2,669,175.43份;C类基金份额为201,058,142.38份),有效认购户数为503户。按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依

法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券、中小企业私募债券、次级债等)、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、债券回购、同业存单、权证、股指期货、国债期货等及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×40%+上证国债指数收益率×60%。

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颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称"企业会计准则")编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币,记账本位币单位为元。

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。

① 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：

a) 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。

b) 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、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

② 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资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；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除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利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本基金的管理人报酬、托管费、销售服务费等按《基金合同》约定的方法进行计提。

(2) 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

(3) 其他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。

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的20%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

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

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

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,本基金确定以下股票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)》，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、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)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、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，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央国债登记结算有限责任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

根据《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》、《企业会计准则第37号--金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通

知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

(1) 以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币4,111,954.91元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1,059.92元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币4,113,014.83元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币380,296.45元，自应收利息转入的重分类金额为人民币188.21元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币380,484.66元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币139,602.39元，自应收利息转入的重分类金额为人民币69.08元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币139,671.47元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币85,805.46元，转出至银行存款的重分类金额为人民币1,059.92元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币188.21元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币69.08元，转出至交易性

金融资产的重分类金额为人民币84,488.25元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

(2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币86,845,025.91元，自应收利息转入的重分类金额为人民币84,488.25元。经上述重分类后，交易性金融资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币86,929,514.16元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、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号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、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。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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	184,057.33	4,111,954.91
等于：本金	183,766.07	4,111,954.91
加：应计利息	291.26	-
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	184,057.33	4,111,954.91

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	25,114,823.31	-	22,823,082.52	-2,291,740.79	
贵金属投资-金交 所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	43,171,656.77	420,203.29	42,905,997.61	-685,862.45
	银行间市场	11,855,527.02	99,690.75	11,757,110.75	-198,107.02
	合计	55,027,183.79	519,894.04	54,663,108.36	-883,969.47
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	80,142,007.10	519,894.04	77,486,190.88	-3,175,710.26	
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		71,095,518.20	-	78,871,401.21	7,775,883.01
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,868,623.74	-	7,973,624.70	105,000.96
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,868,623.74	-	7,973,624.70	105,000.96
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		78,964,141.94	-	86,845,025.91	7,880,883.97

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-144.66	-
银行间市场	-	-
合计	-144.66	-
项目	上年度末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

注：根据交易所实施的债券质押式回购新规，质押式回购计息天数采用资金实际占款天数，故回购到期日为节假日前一日的交易所回购利息余额可能出现负值，未提利息将于节假日期间完成计提

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

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	-	85,805.46
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	85,805.46

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	47.29	68.64
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	11,167.87	128,960.96
其中：交易所市场	6,510.41	128,960.96
银行间市场	4,657.46	-
应付利息	-	-
预提费用	109,300.00	20,000.00
合计	120,515.16	149,029.60

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 中融鑫价值混合A

金额单位：人民币元

项目 (中融鑫价值混合A)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	48,738,280.52	48,738,280.52
本期申购	23,286,277.75	23,286,277.75
本期赎回(以“-”号填列)	-35,189,134.67	-35,189,134.67
本期末	36,835,423.60	36,835,423.60

7.4.7.7.2 中融鑫价值混合C

金额单位：人民币元

项目 (中融鑫价值混合C)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	27,521,366.68	27,521,366.68
本期申购	23,193,132.42	23,193,132.42
本期赎回(以“-”号填列)	-26,238,019.68	-26,238,019.68
本期末	24,476,479.42	24,476,479.42

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 中融鑫价值混合A

单位：人民币元

项目 (中融鑫价值混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	13,641,812.98	-2,319,208.17	11,322,604.81
本期利润	-2,821,201.05	-7,223,751.73	-10,044,952.78
本期基金份额交易产生的变动数	-2,831,143.91	2,039,505.49	-791,638.42
其中：基金申购款	6,497,174.01	-3,328,389.22	3,168,784.79
基金赎回款	-9,328,317.92	5,367,894.71	-3,960,423.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,989,468.02	-7,503,454.41	486,013.61

7.4.7.8.2 中融鑫价值混合C

单位：人民币元

项目 (中融鑫价值混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	5,294,055.89	-1,224,743.28	4,069,312.61
本期利润	-1,550,073.34	-3,832,842.50	-5,382,915.84
本期基金份额交易产生的变动数	-495,861.90	409,679.49	-86,182.41
其中：基金申购款	3,772,562.28	-3,799,039.74	-26,477.46
基金赎回款	-4,268,424.18	4,208,719.23	-59,704.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,248,120.65	-4,647,906.29	-1,399,785.64

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	35,470.25	142,648.38
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	5,333.46	9,194.31
其他	844.18	1,997.68
合计	41,647.89	153,840.37

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.10 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01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
----	-----------------------------------	--

卖出股票成交总额	156,334,133.78	767,675,159.28
减：卖出股票成本总额	161,746,832.40	761,211,633.08
减：交易费用	377,982.97	-
买卖股票差价收入	-5,790,681.59	6,463,526.20

7.4.7.11 基金投资收益

注：无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	753,493.94	-
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	60,367.18	2,508,086.72
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	813,861.12	2,508,086.72

7.4.7.12.2 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01月01日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年01月01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	123,302,531.02	63,224,864.88
减：卖出债券(债	122,269,432.69	60,121,121.73

转股及债券到期兑付) 成本总额		
减: 应计利息总额	964,488.46	595,656.43
减: 交易费用	8,242.69	-
买卖债券差价收入	60,367.18	2,508,086.72

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

注: 无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注: 无。

7.4.7.15 衍生工具收益

注: 无。

7.4.7.16 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,117,151.11	3,209,964.58
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	1,117,151.11	3,209,964.58

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1.交易性金融资产	-11,056,594.23	6,672,821.25
——股票投资	-10,067,623.80	6,585,059.62
——债券投资	-988,970.43	87,761.63

——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-11,056,594.23	6,672,821.25

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
基金赎回费收入	230,760.58	1,642,423.90
转换费收入	151.77	3,028.25
合计	230,912.35	1,645,452.15

7.4.7.19 信用减值损失

注：无。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
审计费用	20,000.00	20,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	4,276.66	8,521.64

账户维护费	13,500.00	-
其他	400.00	-
交易费用	-	1,963,482.47
合计	118,176.66	2,112,004.11

7.4.7.21 分部报告

无。

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
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
中融（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司
中融国际信托有限公司	基金管理人股东
中融基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

注：无。

7.4.10.1.2 权证交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券交易

注：无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

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01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	433,428.35	1,168,660.42
其中：支付销售机构的客户维护费	202,632.24	567,254.13

注：①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，每日计提，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 X 0.60% / 当年天数。

②客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	72,238.14	194,776.64

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，每日计提，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 X 0.10% / 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01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中融鑫价值混合A	中融鑫价值混合C	合计
交通银行股份有限公司	0.00	30.15	30.15
中融基金管理有限公司	0.00	2,076.39	2,076.39
合计	-	2,106.54	2,106.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中融鑫价值混合A	中融鑫价值混合C	合计
中融基金管理有限公司	0.00	2,253.10	2,253.10
交通银行股份有限公司	0.00	42.88	42.88
合计	-	2,295.98	2,295.98

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.10%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给注册登记机构，再由注册登记机构代付给销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。C类基金销售服务费的计算公式为：C类基金份额的日销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.10%/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

注：无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.4.2 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

注：无。

7.4.10.5 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01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	184,057.33	35,470.25	4,111,954.91	142,648.38

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.7 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

注：无。

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**

注：无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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**

注：无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末2022年12月31日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额18,040,652.97元，分别于2023年1月3日和2023年1月12日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节,构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信

用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，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。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,994,319.45	-
合计	1,994,319.45	-

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中包含超短期融资券等，不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	37,333,836.62	2,995,131.60
AAA以下	7,990,932.35	-
未评级	1,969,419.18	-
合计	47,294,188.15	2,995,131.60

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注7.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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因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关于未来现金流的风险。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年1 2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	184,057.33	-	-	-	184,057.33
结算备付金	1,023,413.75	-	-	-	1,023,413.75
存出保证金	15,931.53	-	-	-	15,931.53
交易性金融资产	37,910,674.64	15,333,061.49	1,419,372.23	22,823,082.52	77,486,190.88
买入返售金融资产	-144.66	-	-	-	-144.66
应收清算款	-	-	-	928,637.05	928,637.05
应收申购款	-	-	-	4,263.49	4,263.49
资产总计	39,133,932.59	15,333,061.49	1,419,372.23	23,755,983.06	79,642,349.37
负债					
卖出回购金融资产款	18,040,652.97	-	-	-	18,040,652.97
应付清算款	-	-	-	1,012,550.39	1,012,550.39
应付赎回款	-	-	-	28,572.21	28,572.21
应付管	-	-	-	30,910.75	30,910.75

理人报酬					
应付托管费	-	-	-	5,151.81	5,151.81
应付销售服务费	-	-	-	1,963.90	1,963.90
应交税费	-	-	-	3,901.19	3,901.19
其他负债	-	-	-	120,515.16	120,515.16
负债总计	18,040,652.97	-	-	1,203,565.41	19,244,218.38
利率敏感度缺口	21,093,279.62	15,333,061.49	1,419,372.23	22,552,417.65	60,398,130.99
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	4,111,954.91	-	-	-	4,111,954.91
结算备付金	380,296.45	-	-	-	380,296.45
存出保证金	139,602.39	-	-	-	139,602.39
交易性金融资产	7,973,624.70	-	-	78,871,401.21	86,845,025.91
应收清算款	-	-	-	71,493.59	71,493.59
应收申购款	-	-	-	1,341,158.82	1,341,158.82
其他资产	-	-	-	85,805.46	85,805.46
资产总计	12,605,478.45	-	-	80,369,859.08	92,975,337.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,112,752.26	1,112,752.26
应付管理人报酬	-	-	-	50,454.53	50,454.53

应付托管费	-	-	-	8,409.06	8,409.06
应付销售服务费	-	-	-	3,127.46	3,127.46
其他负债	-	-	-	149,029.60	149,029.60
负债总计	-	-	-	1,323,772.91	1,323,772.91
利率敏感度缺口	12,605,478.45	-	-	79,046,086.17	91,651,564.62

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	假定所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他变量不变；		
假设	其他市场变量保持不变；		
假设	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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
	市场利率下降25个基点	176,240.89	-
	市场利率上升25个基点	-173,396.39	-

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。于报告期末，若市场利率上升或下降25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值可参考的公允价值发生的变动。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	22,823,082.52	37.79	78,871,401.21	86.06
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	54,663,108.36	90.50	7,973,624.70	8.70
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	77,486,190.88	128.29	86,845,025.91	94.76

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察沪深300指数变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量不变；
	3、Beta系数是根据组合在过去一年的净值数据和沪深300指数数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。

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
	沪深300指数上升5%	1,479,544.17	3,869,023.57
沪深300指数下降5%	-1,479,544.17	-3,869,023.57	

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

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	40,678,931.05	80,696,828.82
第二层次	36,807,259.83	5,171,997.59
第三层次	-	976,199.50
合计	77,486,190.88	86,845,025.91

注：根据《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>》的要求，本基金期末使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期股票投资、违约债、非指数收益法估值长期停牌股票等估值模型中使用不可观察输入值进行估值的金融

资产公允价值由第二层次划分为第三层次，同时本基金对上年度末可比数字按照此标准进行了追溯调整。

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停、基金处于封闭期等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

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01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	976,199.50	976,199.50
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	900,409.70	900,409.70
当期利得或损失总额	-	-75,789.80	-75,789.80
其中：计入损益的利得或损失	-	-75,789.80	-75,789.80
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或	-	-	-

项目	上年度可比同期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
损失的变动——公允价值变动损益			
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	957,426.29	957,426.29
转出第三层次	-	1,511,724.21	1,511,724.21
当期利得或损失总额	-	1,530,497.42	1,530,497.42
其中：计入损益的利得或损失	-	1,530,497.42	1,530,497.42
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	976,199.50	976,199.50
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	-	614,656.68	614,656.68

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	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
限售期股票	976,199.50	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.3138%-2.4442%	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

基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§8 投资组合报告**8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,823,082.52	28.66
	其中：股票	22,823,082.52	28.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	54,663,108.36	68.64
	其中：债券	54,663,108.36	68.64
	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	-144.66	0.00
	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	1,207,471.08	1.52
8	其他各项资产	948,832.07	1.19
9	合计	79,642,349.37	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	27,600.00	0.05
C	制造业	8,509,638.70	14.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	139,140.00	0.23
F	批发和零售业	606,500.00	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	119,128.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,013,905.84	1.68
J	金融业	10,609,315.98	17.57
K	房地产业	1,053,760.00	1.74
L	租赁和商务服务业	169,138.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	203,996.00	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	152,100.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	218,860.00	0.36
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,823,082.52	37.79

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	600837	海通证券	151,300	1,314,797.00	2.18
2	000776	广发证券	82,821	1,282,897.29	2.12
3	601211	国泰君安	90,000	1,223,100.00	2.03

4	601398	工商银行	260,700	1,131,438.00	1.87
5	601838	成都银行	65,400	1,000,620.00	1.66
6	300059	东方财富	50,060	971,164.00	1.61
7	601688	华泰证券	70,544	898,730.56	1.49
8	601318	中国平安	16,900	794,300.00	1.32
9	600030	中信证券	37,183	740,313.53	1.23
10	000568	泸州老窖	2,700	605,556.00	1.00
11	001979	招商蛇口	42,000	530,460.00	0.88
12	600570	恒生电子	13,104	530,187.84	0.88
13	002142	宁波银行	13,100	425,095.00	0.70
14	600048	保利发展	27,000	408,510.00	0.68
15	000963	华东医药	7,500	351,000.00	0.58
16	603369	今世缘	6,800	346,120.00	0.57
17	300033	同花顺	3,500	345,135.00	0.57
18	605499	东鹏饮料	1,800	320,220.00	0.53
19	688114	华大智造	2,845	316,107.95	0.52
20	300124	汇川技术	4,200	291,900.00	0.48
21	300661	圣邦股份	1,600	276,160.00	0.46
22	000733	振华科技	2,300	262,729.00	0.43
23	002126	银轮股份	20,000	248,200.00	0.41
24	002304	洋河股份	1,500	240,750.00	0.40
25	002153	石基信息	16,000	239,840.00	0.40
26	002966	苏州银行	30,000	233,400.00	0.39
27	688122	西部超导	2,400	227,256.00	0.38
28	003022	联泓新科	7,400	224,590.00	0.37
29	300395	菲利华	4,000	220,000.00	0.36
30	301239	普瑞眼科	3,100	218,860.00	0.36
31	000887	中鼎股份	15,000	217,050.00	0.36
32	000596	古井贡酒	800	213,520.00	0.35
33	603712	七一二	6,000	209,520.00	0.35
34	002747	埃斯顿	9,500	205,960.00	0.34

35	002088	鲁阳节能	8,500	196,520.00	0.33
36	002025	航天电器	2,900	192,125.00	0.32
37	600153	建发股份	13,500	184,275.00	0.31
38	000792	盐湖股份	8,000	181,520.00	0.30
39	688089	嘉必优	4,000	181,280.00	0.30
40	002176	江特电机	10,000	174,500.00	0.29
41	002101	广东鸿图	8,000	173,360.00	0.29
42	300724	捷佳伟创	1,500	171,030.00	0.28
43	002979	雷赛智能	7,500	169,575.00	0.28
44	000547	航天发展	18,000	169,020.00	0.28
45	601665	齐鲁银行	40,000	166,800.00	0.28
46	601567	三星医疗	12,000	161,760.00	0.27
47	000035	中国天楹	30,000	152,100.00	0.25
48	603345	安井食品	900	145,692.00	0.24
49	300274	阳光电源	1,300	145,340.00	0.24
50	688383	新益昌	1,500	142,320.00	0.24
51	601186	中国铁建	18,000	139,140.00	0.23
52	603501	韦尔股份	1,755	135,292.95	0.22
53	002371	北方华创	600	135,180.00	0.22
54	002837	英维克	4,000	133,240.00	0.22
55	002812	恩捷股份	1,000	131,290.00	0.22
56	601888	中国中免	600	129,618.00	0.21
57	688105	诺唯赞	2,300	122,222.00	0.20
58	300390	天华新能	2,100	117,348.00	0.19
59	688559	海目星	2,000	115,680.00	0.19
60	002244	滨江集团	13,000	114,790.00	0.19
61	002756	永兴材料	1,200	110,604.00	0.18
62	688188	柏楚电子	500	108,540.00	0.18
63	300327	中颖电子	3,000	106,110.00	0.18
64	000933	神火股份	7,000	104,720.00	0.17
65	603678	火炬电子	2,500	102,350.00	0.17

66	002120	韵达股份	7,000	100,660.00	0.17
67	600111	北方稀土	4,000	100,200.00	0.17
68	300915	海融科技	2,300	96,140.00	0.16
69	002223	鱼跃医疗	3,000	95,580.00	0.16
70	603636	南威软件	6,000	82,440.00	0.14
71	603127	昭衍新药	1,400	81,774.00	0.14
72	601136	首创证券	4,680	81,525.60	0.13
73	600329	达仁堂	2,800	81,480.00	0.13
74	301078	孩子王	5,500	71,225.00	0.12
75	603650	彤程新材	2,000	61,660.00	0.10
76	603267	鸿远电子	600	60,696.00	0.10
77	688556	高测股份	800	60,016.00	0.10
78	688111	金山办公	200	52,898.00	0.09
79	300529	健帆生物	1,600	49,552.00	0.08
80	002603	以岭药业	1,500	44,940.00	0.07
81	002707	众信旅游	4,000	39,520.00	0.07
82	601636	旗滨集团	3,000	34,170.00	0.06
83	000975	银泰黄金	2,500	27,600.00	0.05
84	601022	宁波远洋	1,368	18,468.00	0.03
85	001322	箭牌家居	244	3,708.80	0.01

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	002142	宁波银行	12,721,612.50	13.88
2	300059	东方财富	10,124,037.67	11.05
3	601318	中国平安	9,971,462.00	10.88
4	600036	招商银行	9,577,115.00	10.45
5	000776	广发证券	9,443,785.00	10.30

6	601166	兴业银行	7,762,516.00	8.47
7	601398	工商银行	5,164,059.00	5.63
8	601658	邮储银行	4,306,959.00	4.70
9	600919	江苏银行	4,249,599.00	4.64
10	600030	中信证券	4,016,445.70	4.38
11	002966	苏州银行	3,938,197.00	4.30
12	300033	同花顺	3,269,281.90	3.57
13	603323	苏农银行	2,603,095.00	2.84
14	002839	张家港行	2,573,238.00	2.81
15	600837	海通证券	2,402,412.00	2.62
16	601211	国泰君安	1,762,092.00	1.92
17	601377	兴业证券	1,659,212.00	1.81
18	600958	东方证券	1,658,106.00	1.81
19	601688	华泰证券	1,614,076.00	1.76
20	601838	成都银行	880,408.00	0.96

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	300059	东方财富	16,031,024.40	17.49
2	000776	广发证券	13,720,344.00	14.97
3	002142	宁波银行	12,917,421.20	14.09
4	600030	中信证券	11,040,932.12	12.05
5	600036	招商银行	10,777,011.80	11.76
6	601166	兴业银行	8,595,855.72	9.38
7	601318	中国平安	8,382,712.00	9.15
8	601688	华泰证券	7,765,656.00	8.47
9	300033	同花顺	7,322,943.00	7.99
10	600837	海通证券	6,363,436.00	6.94

11	600958	东方证券	6,275,789.00	6.85
12	600570	恒生电子	4,786,217.00	5.22
13	601658	邮储银行	4,691,348.00	5.12
14	600919	江苏银行	4,403,875.00	4.81
15	002966	苏州银行	3,985,989.00	4.35
16	601398	工商银行	3,680,723.00	4.02
17	601211	国泰君安	3,334,063.00	3.64
18	601377	兴业证券	3,252,885.00	3.55
19	000166	申万宏源	2,586,593.00	2.82
20	603323	苏农银行	2,571,956.00	2.81
21	002839	张家港行	2,521,786.00	2.75
22	601108	财通证券	1,959,848.24	2.14
23	002736	国信证券	1,845,776.00	2.01

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	115,766,137.51
卖出股票收入（成交）总额	156,334,133.78

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

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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,687,009.80	6.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,763,329.67	2.92
	其中：政策性金融债	1,108,888.74	1.84
4	企业债券	20,682,026.79	34.24
5	企业短期融资券	1,994,319.45	3.30
6	中期票据	8,101,871.90	13.41

7	可转债(可交换债)	17,855,848.53	29.56
8	同业存单	-	-
9	其他	578,702.22	0.96
10	合计	54,663,108.36	90.50

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	占基金资产净值比例(%)
1	113042	上银转债	40,630	4,266,065.40	7.06
2	019656	21国债08	35,000	3,561,295.07	5.90
3	113052	兴业转债	33,660	3,427,072.15	5.67
4	143562	18川发01	30,000	3,206,988.49	5.31
5	110059	浦发转债	29,940	3,141,579.59	5.20

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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

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 报告期内基金投资的前十名证券除上银转债(113042),兴业转债(113052),浦发转债(110059)外其他证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。上海银保监局2022年02月14日发布对上海银行股份有限公司的处罚(沪银保监罚决字(2022)13号),中国银行间市场交易商协会2023年01月18日发布对兴业银行股份有限公司的处罚,银保监会2022年03月21日发布对兴业银行股份有限公司的处罚(银保监罚决字(2022)22号),银保监会2022年09月28日发布对兴业银行股份有限公司的处罚(银保监罚决字(2022)50号),银保监会2022年09月09日发布对兴业银行股份有限公司的处罚(银保监罚决字(2022)41号),银保监会2022年03月21日发布对上海浦东发展银行股份有限公司的处罚(银保监罚决字(2022)25号),国家外汇管理局上海市分局2022年09月02日发布对上海浦东发展银行股份有限公司的处罚(上海汇管罚字(2022)3111220601号),上海市市场监管局2022年08月17日发布对上海浦东发展银行股份有限公司的处罚(沪市监总处(2022)322021000345号),中国银行间市场交易商协会2022年10月24日发布对上海浦东发展银行股份有限公司的处罚。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作,上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,931.53
2	应收清算款	928,637.05
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,263.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	948,832.07

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113042	上银转债	4,266,065.40	7.06
2	113052	兴业转债	3,427,072.15	5.67
3	110059	浦发转债	3,141,579.59	5.20
4	110053	苏银转债	856,121.92	1.42
5	127018	本钢转债	582,407.53	0.96
6	113056	重银转债	579,892.92	0.96
7	110073	国投转债	525,208.63	0.87
8	110047	山鹰转债	411,879.72	0.68
9	113037	紫银转债	404,272.49	0.67
10	132018	G三峡EB1	398,347.81	0.66
11	127033	中装转2	289,838.97	0.48
12	113631	皖天转债	229,474.68	0.38
13	113044	大秦转债	219,618.90	0.36
14	127019	国城转债	166,353.90	0.28
15	127058	科伦转债	158,996.68	0.26
16	110063	鹰19转债	114,742.47	0.19
17	110064	建工转债	106,587.35	0.18
18	127047	帝欧转债	96,004.52	0.16
19	123121	帝尔转债	78,117.57	0.13
20	110085	通22转债	59,593.16	0.10
21	127040	国泰转债	57,633.03	0.10
22	110061	川投转债	42,878.30	0.07
23	127032	苏行转债	12,014.10	0.02

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中融鑫价值混合A	1,712	21,516.02	-	0.00%	36,835,423.60	100.00%
中融鑫价值混合C	1,602	15,278.70	4,347,035.57	17.76%	20,129,443.85	82.24%
合计	3,314	18,500.88	4,347,035.57	7.09%	56,964,867.45	92.91%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，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）。

9.2 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	中融鑫价值混合A	965.40	0.00%
	中融鑫价值混合C	1,423.46	0.01%
	合计	2,388.86	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中融鑫价值混合A	0
	中融鑫价值混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中融鑫价值混合A	0~10
	中融鑫价值混合C	0~10
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	中融鑫价值混合A	中融鑫价值混合C
基金合同生效日(2018年03月09日)基金份额总额	2,669,175.43	201,058,142.38
本报告期期初基金份额总额	48,738,280.52	27,521,366.68
本报告期基金总申购份额	23,286,277.75	23,193,132.42
减：本报告期基金总赎回份额	35,189,134.67	26,238,019.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	36,835,423.60	24,476,479.42

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于2022年8月6日发布公告，闫军先生担任中融基金管理有限公司副总裁职务。

本基金管理人于2022年8月29日发布公告，卢强先生担任中融基金管理有限公司副总裁职务、黄庆先生担任中融基金管理有限公司首席信息官职务、马荣荣女士卸任中融基金管理有限公司副总裁职务、黎峰先生卸任中融基金管理有限公司首席信息官职务。

本基金管理人于2022年9月30日发布公告，中融基金管理有限公司副总裁黄言先生离任。

公司其他高管人员未变动。

(2) 基金托管人的重大人事变动情况

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，未改聘会计师事务所。该审计机构已经连续4年为本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 20,000.00元人民币。

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

注：本报告期内管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-

东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	270,599,189.70	99.91%	197,890.62	99.91%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
网信证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	248,367.00	0.09%	181.63	0.09%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	退租 2 个 交易 单元。
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	153,733,630.07	84.64%	577,324,000.00	84.20%	-	-	-	-
华泰证券	3,005,660.00	1.65%	-	-	-	-	-	-
网信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	24,884,983.09	13.70%	108,327,000.00	15.80%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	中融基金管理有限公司关于旗下基金执行新金融工具会计准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-04
2	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-15
3	中融基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-17

4	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-21
5	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申万宏源西部证券有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-21
6	中融基金管理有限公司关于暂停深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
7	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-30
8	中融基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-07
9	中融基金管理有限公司基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-07-09
10	中融基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-07-14
11	中融基金管理有限公司关于暂停乾道基金销售有限公司、北京微动利基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-07-20
12	中融基金管理有限公司基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-07-20

13	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-11-02
----	---------------------------------	--------------	------------

§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

注：本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 《中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (4) 关于申请募集中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (7) 中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：中融基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000，(010) 56517299。

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司
二〇二三年三月三十日