

申万菱信价值精选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：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年三月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	15
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	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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 审计意见	18
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 其他信息	19
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	19
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	19
§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	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	65
8.1 期末基金资产组合情况	65
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	65
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	67
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72

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	72
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	72
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	72
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	72
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	72
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12	投资组合报告附注	72
§9	基金份额持有人信息	73
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
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的情况	74
§10	开放式基金份额变动	75
§11	重大事件揭示	75
11.1	基金份额持有人大会决议	75
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	75
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4	基金投资策略的改变	76
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	76
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	76
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	76
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.9	其他重大事件	78
12	影响投资者决策的其他重要信息	79
§13	备查文件目录	79
13.1	备查文件目录	79
13.2	存放地点	80
13.3	查阅方式	80

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信价值精选混合型证券投资基金	
基金简称	申万菱信价值精选混合	
基金主代码	011800	
交易代码	011800	
基金运作方式	普通开放式	
基金合同生效日	2021 年 4 月 27 日	
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	98,771,027.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	申万菱信价值精选混合 A	申万菱信价值精选混合 C
下属分级基金的交易代码	011800	015158
报告期末下属分级基金的份额总额	98,408,136.92 份	362,890.34 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金基于价值投资的理念，重点投资于未来需求具有较大成长空间、产业景气度持续向上、以及通过企业竞争能够持续保持领先优势的细分行业龙头公司。把握产业升级、消费升级及研发升级带来的投资价值，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金综合宏观、中观、微观三个角度布局投资机会，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法构建投资组合。根据经济周期的阶段，进行大类资产配置；根据产业景气趋势的比较，选择重点配置的行业；根据上市公司基本面、财务和估值指标，筛选具备性价比的优质标的；根据市场流动性的状态，适当调整持股的风格。
业绩比较基准	70%×中证 800 指数收益率+10%×恒生指数收益率+20%×中证综合债指

	数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，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		申万菱信基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王菲萍	秦一楠
	联系电话	021-23261188	010-66060069
	电子邮箱	service@swsmu.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008808588	95599
传真		021-23261199	010-68121816
注册地址		上海市中山南路100号11层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200010	100031
法定代表人		陈晓升	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.swsmu.com
基金年度报告备置地点	申万菱信基金管理有限公司 中国农业银行股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海静安区南京西路1266号恒隆广场二期16楼

注册登记机构	申万菱信基金管理有限公司	上海市中山南路 100 号 10、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 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	
	申万菱信价值精 选混合 A	申万菱信价值精 选混合 C	申万菱信价值精选 混合 A	申万菱信价值精选 混合 C
本期已实现 收益	-15,128,186.21	-25,776.20	11,521,232.96	-
本期利润	-19,246,052.26	-22,351.79	13,670,473.72	-
加权平均基 金份额本期 利润	-0.2822	-0.0945	0.0780	-
本期加权平 均净值利润 率	-32.38%	-10.99%	7.65%	-
本期基金份 额净值增长 率	-26.92%	-15.03%	5.30%	-
3.1.2 期末数据 和指标	2022 年末		2021 年末	
	申万菱信价值精选 混合 A	申万菱信价值精选 混合 C	申万菱信价值精选混 合 A	申万菱信价值精选混 合 C
期末可供分 配利润	-22,679,200.15	-108,304.79	3,328,224.01	-
期末可供分 配基金份额 利润	-0.2305	-0.2985	0.0530	-

期末基金资产净值	75,728,936.77	278,402.69	66,150,891.32	-
期末基金份额净值	0.7695	0.7672	1.0530	-
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末	
	申万菱信价值精选混合 A	申万菱信价值精选混合 C	申万菱信价值精选混合 A	申万菱信价值精选混合 C
基金份额累计净值增长率	-23.05%	-15.03%	5.30%	-

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认购或交易基金各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

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

4、本基金自 2022 年 2 月 25 日起增加 C 类基金份额类别，C 类份额自 2022 年 3 月 18 日起实际存续，本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

1. 申万菱信价值精选混合 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	-2.43%	1.10%	2.93%	1.02%	-5.36%	0.08%
过去六个月	-18.42%	1.18%	-9.43%	0.89%	-8.99%	0.29%
过去一年	-26.92%	1.41%	-15.85%	1.04%	-11.07%	0.37%
自基金合同生效起至今	-23.05%	1.32%	-16.29%	0.92%	-6.76%	0.40%

2. 申万菱信价值精选混合 C:

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	-2.53%	1.10%	2.93%	1.02%	-5.46%	0.08%
过去六个月	-18.58%	1.18%	-9.43%	0.89%	-9.15%	0.29%
自基金合同生 效起至今	-15.03%	1.31%	-5.65%	0.98%	-9.38%	0.33%

1、上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、本基金业绩比较基准为：70%×中证 800 指数收益率+10%×恒生指数收益率+20%×中证综合债指数收益率。

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

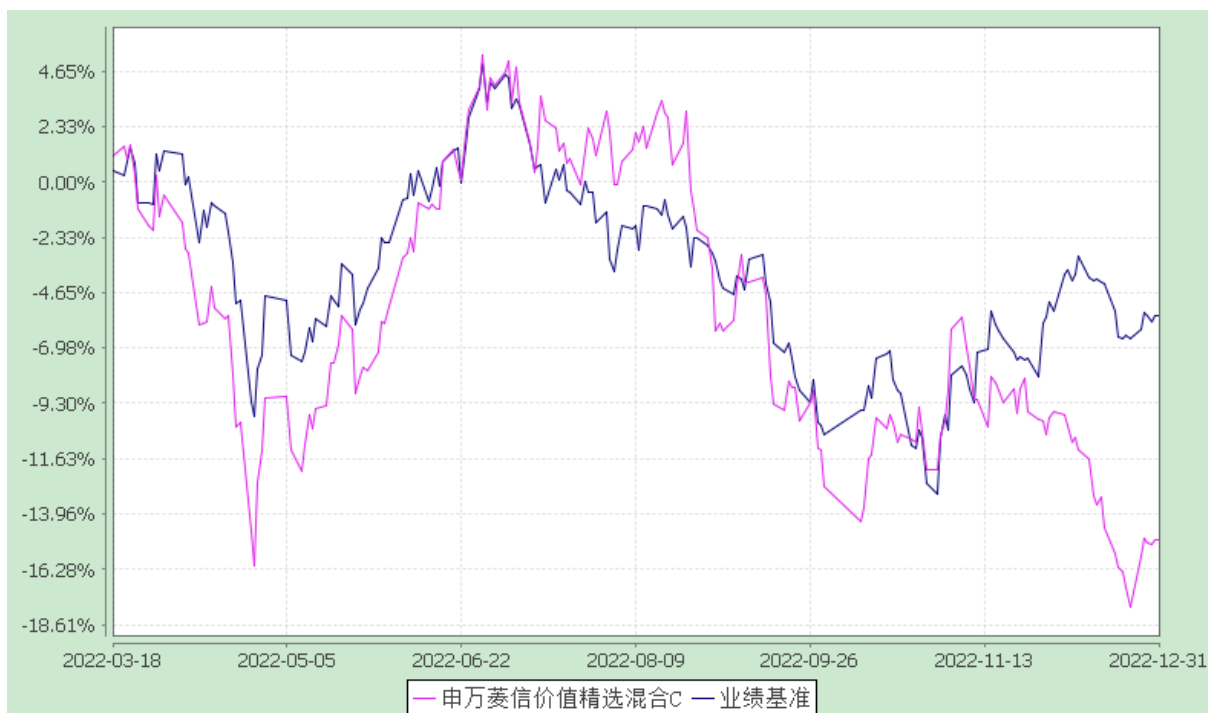
申万菱信价值精选混合型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2021 年 4 月 27 日至 2022 年 12 月 31 日)

1、申万菱信价值精选混合 A



2、申万菱信价值精选混合 C



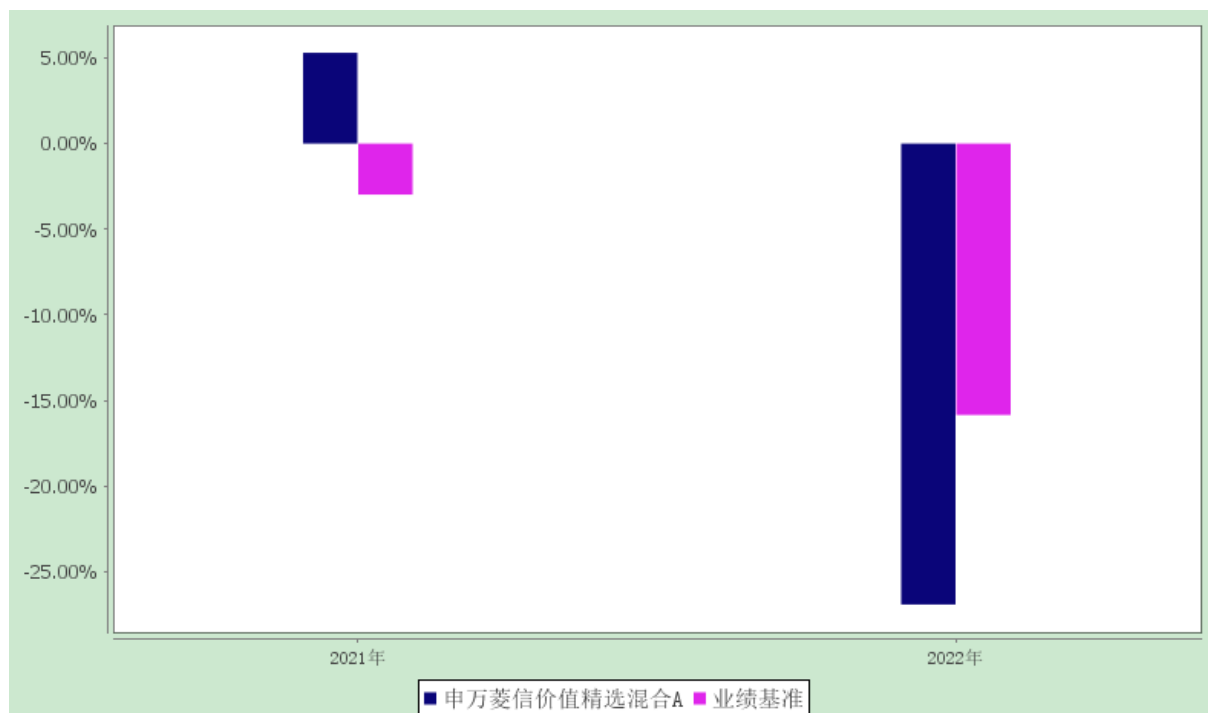
注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

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

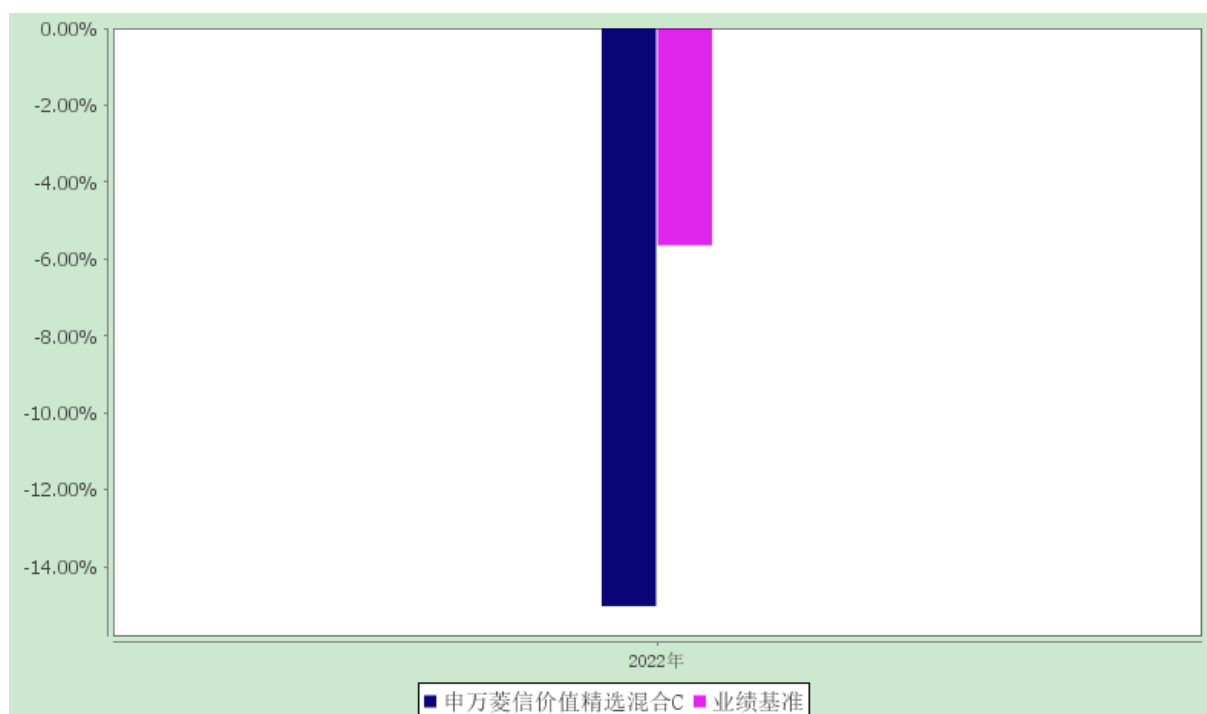
申万菱信价值精选混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、申万菱信价值精选混合 A



2、申万菱信价值精选混合 C



注：（1）本基金合同于 2021 年 4 月 27 日生效，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。

（2）本基金自 2022 年 2 月 25 日起增加 C 类基金份额类别，C 类份额自 2022 年 3 月 18 日起实际存续，故存续起始当年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金的合同生效日为 2021 年 4 月 27 日，截至本报告期末，本基金未进行过利润分配。

§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

申万菱信基金自成立以来，始终将持有人的利益放在首位，秉持“研究至善”的愿景、“长期致胜”的使命，遵循“诚于心、行于矩、敏于变”的企业价值观。近年来，申万菱信基金围绕市场和客户需求，逐渐形成“投资美好生活、创新理财服务”的产品规划；通过努力打造“美好生活”系列权益产品，不断丰富“全市场、宽基指数与增强、主题指数、量化对冲、固收+、另类投资和纯固收”等产品大类，致力于为持有人提供“温暖陪伴”的服务，以努力达成“长期致胜”的使命。公司现有公募基金 76 只，资产管理规模超过 977.43 亿元，公募产品累计分红 191.62 亿元。（数据截至 2022 年 12 月 31 日）

近年来，申万菱信基金通过建设关键假设平台(Key Assumption Platform)，推动“研究数字化”；

通过基金经理的风格开发、稳定和优化，推动“投资风格化”；通过风险管理工作的关口前移，加强市场风险管理支持，推动“风控全流程”，从而不断建设申万菱信基金的“机构理性”，以提升投资业绩。此外，申万菱信基金还持续打造卓越战略与产品管理体系（Excellent Strategy & Product）、卓越品牌与客户服务体系（Excellent Branding & Service），提升面向不同类别客户的全方位专业服务水平。

申万菱信基金股东实力雄厚，中央汇金公司控股的申万宏源证券持有公司 67% 的股份，日本三菱 UFJ 信托银行持有公司 33% 的股份。申万菱信基金拥有公开募集证券投资基金管理人、特定客户资产管理人、合格境内机构投资者(QDII)管理人、保险资金投资管理人、基金投资顾问、合格境内有限合伙人(QDLP)等业务资格，并全资设立申万菱信（上海）资产管理有限公司，专门从事特定客户资产管理业务和专项资产管理业务。公司曾多次荣获中国基金业金牛奖、中国明星基金奖、中国金基金奖等多项业内重量级奖项以及东方财富“最佳指数投资团队”等荣誉。

展望未来，申万菱信基金将紧紧依托双方股东优势，不断深化体制机制改革，以更加市场化的导向推动专业队伍的全方位发展，努力将公司打造成为一家优秀乃至卓越的资产管理机构！

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
周小波	副总经理、本基金基金经理	2021-04-27	-	16 年	周小波先生，硕士研究生。2006 年起从事金融相关工作，曾任职于上海申银万国证券研究所有限公司、太平资产管理有限公司。2020 年 05 月加入申万菱信基金，现任公司副总经理，申万菱信新动力混合型证券投资基金、申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信价值精选混合型证券投资基金、申万菱信盛利精选证券投资基金、申万菱信多策略灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信智能驱动股票型证券投资基金基金经理。
苗琦	本基金基金经理	2022-10-21	-	5 年	苗琦女士，硕士研究生。2017 年起从事金融相关工作，曾任职于农银汇理基金管理有限公司、国泰基金管理有限公司等，2021 年 11 月加入申万菱信基金，现任申

					万菱信价值精选混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	-----------------------

注：1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自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.证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

3、本报告期内，公司聘任苗琦担任本基金基金经理，具体见本基金管理人的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，信息披露及时、准确、完整；本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开；没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中，无任何损害基金持有人利益的行为，并通过稳健经营、规范运作、规避风险，保护了基金持有人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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《公平交易办法》，通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本公司建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序；其次，公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相

互隔离；另外，公司还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部，实行了集中交易制度和公平的交易分配制度：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；（2）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，各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事前审核，确保交易得到公平和公允的执行。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控；对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上，风险管理部在每个季度和每年度的《公平交易执行报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

对于场内同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3 日内和 5 日内）同买或者同卖场内同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。首先，假设两两组合在本报告期的价差率呈正态分布且平均价差率为 0，我们进行了 95% 的置信度、假设平均价差率为 0 的 T 检验，若通过该假设检验，则认为该两两组合的交易得到了公平的执行；对于未通过假设检验的情况，我们还计算了两两组合价差占优比差、模拟输送比例等指标；若综合以上各项指标，认为仍存在一定的嫌疑，则我们将进一步对该两两组合同向买卖特定场内证券的时点、价格、数量等作分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。经分析本期未发生异常情况。

对于场外同向交易，我们分析了本报告期内不同时间窗口内（日内、3 日内和 5 日内）两两组合同向交易的价差率、对比市场公允价格和交易对手，未发现利益输送的情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控与报告办法》，明确定义了投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司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% 的情况有 3 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

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 年是个不平凡的年份，一季度，美联储加息预期下美债剧烈上行，权益市场和债券市场均出现较大波动，随后俄乌冲突又加剧了风险偏好的波动。进入二季度后，上海疫情又让市场情绪雪上加霜，直到 4 月底市场开始反弹，三季度，房地产保交楼的严峻形势催生了中小盘风格的明显超额收益。四季度后，市场波动进一步放大，前半季度市场主线围绕被二十大积极定调的安全和发展进行展开，后半季度市场则主要围绕防疫政策的放松进行波动，其中，理财产品赎回潮则进一步加剧了四季度后半段市场的波动，但同时，11 月后美债阶段见顶，外资开始持续流入中国。本基金 1 季度权益仓位较低，2 季度提升了权益仓位，结构上，配置相对均衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类产品报告期内净值表现为-26.92%，同期业绩基准表现为-15.85%。

自基金合同生效日起，本基金 C 类产品净值表现为-15.03%，同期业绩基准表现为-5.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前，我们能看到，2022 年让市场变得不平凡的因素也发生了反转：美联储加息进入后半段，三年大疫终于结束，房地产政策也在积极出台。对于股票市场心态应该更加的积极，虽然每个人对于国内经济复苏的强度和海外衰退的节奏有不同的预期，但是我们依然相信在今年正向的 β 下能通过研究寻找到有超额收益的标的。

我们在精力分配上除了自下而上的寻找高增长的成长标的，也加大了自上而下的研究分析和决策。一方面，我们认为高端制造对内有自主可控的刚性需求，对外有竞争全球市场份额的机遇。以新能源、军工、电子、计算机等为代表的高端制造行业，未来长周期维度需求较大，技术创新层出不穷，我们将继续围绕 3 个核心要素进行个股深度挖掘——即技术/产品渗透率、国产化率、行业份

额集中度。另一方面，我们看好中国经济的韧性反弹，围绕化工、机械、消费等顺周期的板块也进行了布局，力求优选业绩增长性高的龙头公司。

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，监察稽核工作继续秉承以合规促进发展的理念，着眼于促进合规建设与可持续发展，重点从优化制度流程、完善内部授权体系、推进合规文化建设、强化员工行为监测、深化内审稽核检查、防范合规风险等方面着手，积极构建全面合规管理体系。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核工作重点包括：

1、全面检视和梳理内部制度和业务流程，内部控制机制得到进一步完善。本报告期内，公司根据最新法规政策的要求，结合业务运作情况，秉持规范内控流程、优化管理机制的原则对相关制度进行建设、梳理与修订，以加强对公司各项业务活动的管理，促进公司经营规范化和决策科学化。同时在公司上下进一步传导制度建设文化，有效提升合规效能。

2、深入开展合规宣导培训，强化员工行为管控。坚持实时跟踪法律、法规、准则变化和监管动态，通过各种形式加强合规传导，深入推进合规文化建设。持续强化员工行为管控，促进员工依法依规履行职责，员工职业操守和行为规范的合规意识得到不断强化。

3、以落实廉洁从业规定为契机，促进业务合规发展。建立廉洁从业有效联动机制，积极开展廉洁从业风险点自查及防控机制建设工作，落实“行于矩，坚守底线、敬畏法治”合规管理要求，持续推进公司廉洁从业文化建设。

4、深化各类内审稽核，防范合规风险。按年度计划开展了对多条线多业务的常规稽核工作，多方着手加强后续监督执行；稳步开展定期合规检查，及时优化内控体系，强化公司制度执行和落实，进一步防范合规风险。

5、强化宣传推介材料合规审核，做好合法合规营销。明确公司宣传推介材料合规口径，加强基金宣传推介材料的流程管理，积极开展合规培训，提高合规意识，保护基金持有人的合法权益。

6、履行信息披露义务，维护基金投资人的知情权。严格按照信息披露相关法规规定，梳理完善信息披露管理工作机制，组织落实各项信息披露工作。

7、完善反洗钱内控体系建设，进一步加强洗钱风险管控。坚持“风险为本”的反洗钱基本政策，落实反洗钱法律法规的规定，不断完善反洗钱制度体系建设，落实业务部门参与反洗钱工作事宜，通过持续的培训、宣传等方式提升反洗钱合规意识。

本报告期内，在监察稽核工作的开展过程中本基金管理人未发现投资运作等方面存在与法律法规或基金合同约定相违背的情况。今后本基金管理人将继续坚持基金份额持有人利益优先的原

则，以科学的风险管理为基础，积极有效地开展监察稽核工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引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。本基金托管人根据法律法规要求履行估值政策及净值计算的复核责任。会计师事务所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技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。本基金管理人估值委员会成员包括督察长、分管基金投资的副总经理、分管基金运营的副总经理、基金运营部门负责人、法律合规与审计部门负责人、风险管理部门负责人。以上成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规、基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与最终决策和日常估值的执行。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所债券市场的估值数据。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—申万菱信基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，申万菱信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，申万菱信基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2303823 号

申万菱信价值精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的申万菱信价值精选混合型证券投资基金（以下简称“该基金”）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报表附注。

6.1 审计意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 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”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 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。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“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，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

该基金管理人申万菱信基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 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。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,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,该基金管理人管理层负责评估该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,除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也

执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价该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。

(4) 对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

黄小熠 侯雯

上海静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 16 楼

2023 年 3 月 30 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：申万菱信价值精选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	16,349,695.17	6,596,002.95
结算备付金		1,116,438.98	821,796.06
存出保证金		26,584.33	47,525.58
交易性金融资产	7.4.7.2	60,364,327.22	58,164,144.08
其中：股票投资		60,364,327.22	58,164,144.08
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	1,145,226.66
应收股利		-	-
应收申购款		765.83	58,686.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	2,098.45
资产总计		77,857,811.53	66,835,479.91
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2022 年 12 月 31 日	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		1,308,354.92	109,495.10
应付赎回款		11,455.75	197,381.57
应付管理人报酬		98,804.48	95,044.35
应付托管费		16,467.38	15,840.72
应付销售服务费		95.77	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	415,293.77	266,826.85
负债合计		1,850,472.07	684,588.59
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	98,771,027.26	62,822,667.31
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-22,763,687.80	3,328,224.01
净资产合计		76,007,339.46	66,150,891.32
负债和净资产总计		77,857,811.53	66,835,479.91

注：（1）报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 98,771,027.26 份。A 类基金份额净值 0.7695 元，份额总额 98,408,136.92 份；C 类基金份额净值 0.7672 元，份额总额 362,890.34 份。

（2）本基金基金合同于 2021 年 4 月 27 日生效，上年度可比期间为 2021 年 4 月 27 日至 2021 年 12 月 31 日。

（3）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：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中

“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：申万菱信价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 4 月 27 日（基 金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-18,050,689.41	16,511,666.77
1.利息收入		79,696.75	1,124,850.93
其中：存款利息收入	7.4.7.9	79,696.75	1,001,323.12
债券利息收入		-	20.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	123,506.87
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-14,030,124.39	11,667,938.33
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-14,524,408.14	11,587,011.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	22,952.40	20,974.84
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	471,331.35	59,951.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-4,114,441.64	2,149,240.76
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	14,179.87	1,569,636.75
减：二、营业总支出		1,217,714.64	2,841,193.05
1. 管理人报酬		887,783.33	1,824,413.78
2. 托管费		147,963.79	304,068.98
3. 销售服务费		617.30	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		0.05	0.07
8. 其他费用	7.4.7.19	181,350.17	712,710.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,268,404.05	13,670,473.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,268,404.05	13,670,473.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-19,268,404.05	13,670,473.72

注：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：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“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：申万菱信价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净	62,822,667.31	3,328,224.01	66,150,891.32

值)			
二、本期期初净资产(基金净值)	62,822,667.31	3,328,224.01	66,150,891.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	35,948,359.95	-26,091,911.81	9,856,448.14
(一)、综合收益总额	-	-19,268,404.05	-19,268,404.05
(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)	35,948,359.95	-6,823,507.76	29,124,852.19
其中: 1.基金申购款	48,530,508.56	-8,243,961.07	40,286,547.49
2.基金赎回款	-12,582,148.61	1,420,453.31	-11,161,695.30
(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、本期期末净资产(基金净值)	98,771,027.26	-22,763,687.80	76,007,339.46
项目	上年度可比期间		
	2021年4月27日(基金合同生效日)至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	477,935,514.24	-	477,935,514.24
二、本期期初净资产(基金净值)	-	-	-
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-415,112,846.93	3,328,224.01	-411,784,622.92
(一)、综合收益总额	-	13,670,473.72	13,670,473.72
(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)	-415,112,846.93	-10,342,249.71	-425,455,096.64

其中：1.基金申购款	44,486,306.07	304,326.75	44,790,632.82
2.基金赎回款	-459,599,153.00	-10,646,576.46	-470,245,729.46
(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、本期期末净资产(基金净值)	62,822,667.31	3,328,224.01	66,150,891.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 汪涛, 主管会计工作负责人: 王伟, 会计机构负责人: 徐越

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

申万菱信价值精选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[2021]131号《关于准予申万菱信价值精选混合型证券投资基金注册的批复》核准,由申万菱信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《申万菱信价值精选混合型证券投资基金基金份额发售公告》发售。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 477,879,868.85 元。经向中国证监会备案,《申万菱信价值精选混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 4 月 27 日生效。基金合同生效日的基金份额总额为 477,935,514.24 份基金份额,其中认购资金利息折合基金份额 55,645.39 份。本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《关于旗下部分基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》,本基金自 2022 年 2 月 25 日起增加 C 类基金份额。增加 C 类份额后,本基金将分设 A 类和 C 类两类基金份额,分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。投资者申购时自主选择 A 类基金份额或 C 类基金份额进行申购。不同基金份额类别之间不能相互转换。原有的持有本基金份额的投资人,其基金账户中保留的本基金份额余额为 A 类基金份额。本基金自 2022 年 2 月 25 日起开始办理 C 类基金份额的申购、赎回、转换与定期定额投资业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《申万菱信价值精选混合型证券投资基金基金合同》和最新公布的《申万菱信价值精选混合型证券投资基金更新招募说明书》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、创业板及其他依法发行、上市的股票及存托凭证）、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“港股通标的股票”）、股指期货、国债期货、股票期权、债券（含国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债、可交换债券、地方政府债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-95%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权合约需缴纳的现金保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股票期权、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法

律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：70%×中证 800 指数收益率+10%×恒生指数收益率+20%×中证综合债指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，

真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况、2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 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，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金通常根据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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：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其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。本基金目前暂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。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被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，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无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。

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分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

管理金融资产的**业务模式**，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的**业务模式**。

本基金对金融资产的**合同现金流量特征**进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金在初始确认时将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定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。

- 以摊余成本计量的金融负债

该类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。

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

金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

i. 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

ii. 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

iii. 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有

资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

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份额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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产利息收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。本基金的交易费用于进行股票、债券、基金、权证等交易发生时按照确定的金额确认并计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

债券利息按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认为当期损益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，计算利息计入当期损益。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息计入当期损益。

转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

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等按照权责发生制原则，在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入当期损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入当期损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分为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。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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》，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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《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》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年

中国证监会发布修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》。

(a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《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》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 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 (3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》编制财务报

表时，调整了部分财务报表项目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

执行上述会计政策对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则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、应收清算款、应收利息、应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 6,596,002.95 元、821,796.06 元、47,525.58 元、1,145,226.66 元、2,098.45 元、58,686.13 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则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、应收清算款、应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 6,597,582.75 元、822,291.17 元、47,549.12 元、1,145,226.66 元、58,686.13 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 58,164,144.08 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 58,164,144.08 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 109,495.10 元、197,381.57 元、95,044.35 元、15,840.72 元、121,789.54 元和 145,037.31 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 109,495.10 元、

197,381.57 元、95,044.35 元、15,840.72 元和 266,826.85 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和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，本基金按照新金融工具准则，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、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(ii) 采用“预期信用损失”模型的影响

“预期信用损失”模型适用于本基金持有的以摊余成本计量的金融资产。采用“预期信用损失”模型未对本基金 2022 年年初留存收益产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《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 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关

于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《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 号文《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》、中投信 (2021) 20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告 2019 年第 93 号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税 (2014) 81 号《财政部、国家税务总局、中国证券监督管理委员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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增

值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 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、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

对内地个人投资者通过沪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。

内地个人投资者通过沪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。个人投资者在国外已缴纳的预提税，可持有效扣税凭证到中国结算的主管税务机关申请税收抵免。

对内地企业投资者通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，计入其收入总额，依法计征企业所得税。其中，内地居民企业连续持有 H 股满 12 个月取得的股息红利所得，依法免征企业所得税。

(e) 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。对于

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。

根据香港联合交易所有限公司（以下简称联交所）上调股票交易印花税公告，自 2021 年 8 月 1 日起，香港市场的股票交易印花税由按成交金额的 0.1% 双向收取，上调为按成交金额的 0.13% 双向收取（取整到元，不足一元按一元计）。按照《上海证券交易所沪港通业务实施办法》第七十六条的有关规定，投资者进行沪港通下的港股通交易，应按照联交所市场的有关规定交纳相关费用。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，自 2019 年 12 月 5 日起至 2022 年 12 月 31 日止，继续暂免征收个人所得税。对内地企业投资者通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得，计入其收入总额，依法征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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	16,349,695.17	6,596,002.95
等于：本金	16,345,675.20	6,596,002.95
加：应计利息	4,019.97	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	16,349,695.17	6,596,002.95

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	62,329,528.10	-	60,364,327.22	-1,965,200.88
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	62,329,528.10	-	60,364,327.22	-1,965,200.88
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	56,014,903.32	-	58,164,144.08	2,149,240.76
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	56,014,903.32	-	58,164,144.08	2,149,240.76

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

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均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

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	-	2,098.45
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	2,098.45

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	37.31
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	240,293.77	121,789.54
其中：交易所市场	240,293.77	121,789.54
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提信息披露费	120,000.00	90,000.00
预提审计费用	55,000.00	55,000.00
合计	415,293.77	266,826.85

7.4.7.7 实收基金

申万菱信价值精选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	62,822,667.31	62,822,667.31
本期申购	47,686,364.53	47,686,364.53
本期赎回（以“-”号填列）	-12,100,894.92	-12,100,894.92
本期末	98,408,136.92	98,408,136.92

申万菱信价值精选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额	账面金额
本期申购	844,144.03	844,144.03
本期赎回（以“-”号填列）	-481,253.69	-481,253.69
本期末	362,890.34	362,890.34

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(3) 自 2022 年 2 月 25 日起, 对本基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额, 原基金份额转为 A 类基金份额。

7.4.7.8 未分配利润

申万菱信价值精选混合 A

单位: 人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,495,258.70	-5,167,034.69	3,328,224.01
本期期初	8,495,258.70	-5,167,034.69	3,328,224.01
本期利润	-15,128,186.21	-4,117,866.05	-19,246,052.26
本期基金份额交易产生的变动数	-4,182,302.19	-2,579,069.71	-6,761,371.90
其中: 基金申购款	-3,916,572.86	-4,214,836.62	-8,131,409.48
基金赎回款	-265,729.33	1,635,766.91	1,370,037.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,815,229.70	-11,863,970.45	-22,679,200.15

申万菱信价值精选混合 C

单位: 人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	-25,776.20	3,424.41	-22,351.79
本期基金份额交易产生的变动数	-82,528.59	20,392.73	-62,135.86
其中: 基金申购款	-184,524.99	71,973.40	-112,551.59
基金赎回款	101,996.40	-51,580.67	50,415.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-108,304.79	23,817.14	-84,487.65

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	上年度可比期间 2021 年 4 月 27 日 (基金合同

	31 日	生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	62,898.69	357,280.84
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	2,729.74	2,682.16
其他	14,068.32	641,360.12
合计	79,696.75	1,001,323.12

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	250,817,823.90	170,372,470.14
减：卖出股票成本总额	264,564,632.09	158,785,458.29
减：交易费用	777,599.95	-
买卖股票差价收入	-14,524,408.14	11,587,011.85

7.4.7.10.2 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益-申购差价收入。

7.4.7.10.4 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
----	--	---

		日
债券投资收益——利息收入	34.54	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	22,917.86	20,974.84
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	22,952.40	20,974.84

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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年4月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	125,956.28	78,396.35
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	103,000.00	57,400.00
减：应计利息总额	35.20	21.51
减：交易费用	3.22	-
买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	22,917.86	20,974.84

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年4月27日（基金合同生效

		日)至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	471,331.35	59,951.64
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	471,331.35	59,951.64

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年4月27日（基金合同生效 日)至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-4,114,441.64	2,149,240.76
——股票投资	-4,114,441.64	2,149,240.76
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-4,114,441.64	2,149,240.76

7.4.7.17 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4月27日（基金合同生效日)至 2021年12月31日

基金赎回费收入	14,165.44	1,562,539.43
转换费收入	14.43	7,097.32
合计	14,179.87	1,569,636.75

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

7.4.7.19 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4月27日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
审计费用	55,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	90,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	6,350.17	9,650.57
交易费用	-	558,059.65
合计	181,350.17	712,710.22

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
申万菱信基金管理有限公司（以下简称“申万菱信”）	基金管理人、基金销售机构、基金注册 登记机构
申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金销售机构
三菱 UFJ 信托银行株式会社	基金管理人的股东
中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
申万菱信（上海）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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4月27日（基金合同生效日） 至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
申万宏源	131,868,063.49	25.30%	49,592,586.96	12.89%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
申万宏源	121,396.04	25.21%	64,375.39	26.79%
关联方名称	上年度可比期间 2021年4月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日			

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
申万宏源	45,500.74	12.87%	10,984.87	9.02%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。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。

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4月27日（基金合同 生效日）至2021年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	887,783.33	1,824,413.78
其中：支付销售机构的客户维护费	382,745.37	703,582.31

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

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4月27日（基金合同 生效日）至2021年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	147,963.79	304,068.98

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

(1) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times C \text{ 类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

(2) 自 2022 年 02 月 25 日起，本基金增加收取销售服务费的 C 类份额。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

本报告期和上年度可比期间内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

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

本期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方，未发生投资本基金的情况。

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4月27日（基金合同生效日） 至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有 限公司	16,349,695.17	62,898.69	6,596,002.95	357,280.84

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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融出证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中高风险品种，本基金管理人从事风险管理的主要目标是通过采用积极主动的分散化投资策略，在严格控制投资风险的前提下，实现基金资产的保值增值，力争为投资者获取超过业绩基准的长期投资收益。

本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本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，将风险控制可在承受的范围之内。

本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务而产生。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行或其他国内大中型商业银行，本基金管理人认为与以上银行相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成债券等投资品种的交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小，本基金管理人认为在交易所进行的交易涉及的信用风险不重大。

对于银行间债券等品种的交易，本基金管理人主要通过事前检查和控制交易对手信用及交割方式来管理风险。

对于发行者的信用风险控制，本基金管理人主要通过通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象来管理。于本期末，本基金持有除国债、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%（上期末：0%）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指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主要来源于基金兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

本基金管理人已经建立涵盖制度、流程、组织架构、制衡机制、风险处置等方面的流动性风险管控体系；建立以压力测试为核心、覆盖全类型产品的基金流动性风险监测与预警制度及风险应对预案。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人已经建立针对公募基金申购赎回状况的监控和预测机制以及建立了巨额赎回审批规程，对于巨额赎回建立严格的流动性评估机制；此外，本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对资产的流动性风险，本基金管理人持续监控和预测旗下基金的各项流动性指标，包括组合持仓集中度指标、投资组合在短时间内变现能力的综合指标、组合持仓中变现能力较差的品种的比例控制和流通受限资产的总量控制，通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制投资组合的投资流动性风险。

除了上述日常流动性管理机制外，本基金管理人已建立压力测试制度，针对不同类型投资组合建立流动性压力测试模型，对各相关风险因子进行极端假设，进而评估对投资组合流动性的负面影响。此外，本基金管理人已建立流动性风险应急机制，一旦发生或认为可能发生较大的流动性风险，本基金管理人会立即启动相应的应急流程。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余是流动性较好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具、银行存款和结算备付金，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 7.4.12。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%。

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。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投资的公允价值。于本期末，除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购证券款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

同时，本基金的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本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的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。

综合上述各项流动性指标的监测结果、流动性风险管理措施的实施以及本基金的资产和负债情况，本基金管理人认为本基金在本报告期内流动性情况良好。

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

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。

于本期末，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。

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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	16,349,695.17	-	-	-	-	-	16,349,695.17
结算备付金	1,116,438.98	-	-	-	-	-	1,116,438.98
存出保证金	26,584.33	-	-	-	-	-	26,584.33
交易性金融资产	-	-	-	-	-	60,364,327.22	60,364,327.22
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	765.83	765.83
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	17,492,718.48	-	-	-	-	60,365,093.05	77,857,811.53
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融	-	-	-	-	-	-	-

资产款							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,308,354.92	1,308,354.92
应付赎回款	-	-	-	-	-	11,455.75	11,455.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	98,804.48	98,804.48
应付托管费	-	-	-	-	-	16,467.38	16,467.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-	95.77	95.77
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	415,293.77	415,293.77
负债总计	-	-	-	-	-	1,850,472.07	1,850,472.07
利率敏感度缺口	17,492,718.48	-	-	-	-	58,514,620.98	76,007,339.46
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,596,002.95	-	-	-	-	-	6,596,002.95
结算备付金	821,796.06	-	-	-	-	-	821,796.06
存出保证金	47,525.58	-	-	-	-	-	47,525.58
交易性金融资产	-	-	-	-	-	58,164,144.08	58,164,144.08
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,145,226.66	1,145,226.66
应收利息	-	-	-	-	-	2,098.45	2,098.45
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	58,686.13	58,686.13
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,465,324.59	-	-	-	-	59,370,155.32	66,835,479.91
负债							

短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	109,495.10	109,495.10
应付赎回款	-	-	-	-	-	197,381.57	197,381.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	95,044.35	95,044.35
应付托管费	-	-	-	-	-	15,840.72	15,840.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	121,789.54	121,789.54
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	145,037.31	145,037.31
负债总计	-	-	-	-	-	684,588.59	684,588.59
利率敏感度缺口	7,465,324.59	-	-	-	-	58,685,566.73	66,150,891.32

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0%（上期末：0%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期末：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金因通过港股通持有港股投资，因此有一定的外汇风险。

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	港币	合计

	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	682,190.30	682,190.30
资产合计	-	682,190.30	682,190.30
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	-	682,190.30	682,190.30
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	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	0.00	0.00
资产合计	-	0.00	0.00
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	-	0.00	0.00

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	增加约 30,000.00	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 30,000.00	-

7.4.13.4.3 其他价格风险

基金的其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金的市场价格风险主要来源于本基金投资的股权和债权工具的未来价格可能受到一般市场波动或是其他影响个别股权工具价值的特定风险影响。由于本基金是一只中高风险的混合型证券投资基金，股票资产的配置一般情况下在 60% 至 95% 的比例，所以存在很高的其他价格风险。

本基金管理人通过采用双线并行的投资组合策略，自上而下地进行证券品种的资产配置，自下而上地精选股票。结合宏观及微观环境的变化，定期或不定期对投资策略、资产配置、基金资产投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

此外，本基金管理人在构建基金资产配置和资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差以及运用多种定量的方法对基金进行风险度量，来测试基金的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制，争取将风险控制在可承受的范围内。

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	60,364,327.22	79.42	58,164,144.08	87.93
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	60,364,327.22	79.42	58,164,144.08	87.93

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（见附件 7.4.1）中的股票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
	基准上升 5%	增加约 2,310,000.00	增加约 2,260,000.00
	基准下降 5%	减少约 2,310,000.00	减少约 2,260,000.00

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

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	60,364,327.22	58,081,211.47
第二层次	-	82,932.61
第三层次	-	-
合计	60,364,327.22	58,164,144.08

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。对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

7.4.14.2.3 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	股票投资	
期初余额	-		-
当期购买	-		-
当期 出售/结 算	-		-
转入 第三层次	-	77,428.12	77,428.12
转出 第三层次	-	71,323.51	71,323.51
当期 利得或损 失总额	-	-6,104.61	-6,104.61
其中：计入 损益的利 得或损失	-	-6,104.61	-6,104.61
计入其他 综合收益 的利得或 损失（若 有）	-		-
期末 余额	-		-
期末 仍持有的 第三层次 金融资产 计入本期 损益的未 实现利得 或损失的 变动—— 公允价值 变动损益	-		-

7.4.14.2.3.1 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

于2022年12月31日，本基金未持有所属层次为第三层次的金融工具(2021年12月31日：无)。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2021 年 12 月 31 日:无)。

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工具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之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 12 月 31 日,本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	60,364,327.22	77.53
	其中:股票	60,364,327.22	77.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,466,134.15	22.43
8	其他各项资产	27,350.16	0.04
9	合计	77,857,811.53	100.00

注:本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 682,190.30 元,占期末净值比例 0.90%。

8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	44,779,839.94	58.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,730,984.00	3.59
E	建筑业	1,453,384.00	1.91
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,837,288.60	2.42
J	金融业	6,458,869.38	8.50
K	房地产业	364,000.00	0.48
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	355,069.00	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	811,900.00	1.07
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	890,802.00	1.17
	合计	59,682,136.92	78.52

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值 (人民币)	占基金资产净值比例 (%)
日常消费品	682,190.30	0.90
合计	682,190.30	0.90

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

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	占基金资产净值比例(%)
1	688032	禾迈股份	5,530.00	5,182,439.50	6.82
2	603191	望变电气	154,300.00	3,428,546.00	4.51
3	603867	新化股份	84,500.00	2,729,350.00	3.59
4	601628	中国人寿	68,300.00	2,535,296.00	3.34
5	000733	振华科技	21,800.00	2,490,214.00	3.28
6	300059	东方财富	117,800.00	2,285,320.00	3.01
7	603267	鸿远电子	20,200.00	2,043,432.00	2.69
8	002895	川恒股份	77,400.00	2,017,818.00	2.65
9	000591	太阳能	269,800.00	1,977,634.00	2.60
10	300806	斯迪克	82,700.00	1,939,315.00	2.55
11	300679	电连技术	52,100.00	1,927,700.00	2.54
12	600436	片仔癀	6,500.00	1,874,990.00	2.47
13	600570	恒生电子	45,410.00	1,837,288.60	2.42
14	301349	信德新材	15,200.00	1,678,992.00	2.21
15	601318	中国平安	33,100.00	1,555,700.00	2.05
16	601390	中国中铁	261,400.00	1,453,384.00	1.91
17	688628	优利德	49,558.00	1,424,792.50	1.87
18	600426	华鲁恒升	36,300.00	1,203,345.00	1.58
19	603816	顾家家居	27,000.00	1,153,170.00	1.52
20	300252	金信诺	155,700.00	1,147,509.00	1.51
21	000819	岳阳兴长	50,600.00	1,128,380.00	1.48
22	300719	安达维尔	96,100.00	1,086,891.00	1.43
23	688048	长光华芯	10,776.00	1,042,578.00	1.37
24	600603	广汇物流	108,900.00	890,802.00	1.17
25	603197	保隆科技	17,900.00	846,670.00	1.11
26	600309	万华化学	8,800.00	815,320.00	1.07
27	301239	普瑞眼科	11,500.00	811,900.00	1.07
28	603032	德新科技	9,000.00	789,840.00	1.04
29	601012	隆基绿能	18,400.00	777,584.00	1.02
30	603931	格林达	28,000.00	761,040.00	1.00
31	002129	TCL 中环	20,200.00	760,732.00	1.00
32	000690	宝新能源	115,900.00	753,350.00	0.99
33	300408	三环集团	24,400.00	749,324.00	0.99
34	001269	欧晶科技	7,500.00	744,300.00	0.98
35	600075	新疆天业	133,600.00	730,792.00	0.96
36	000807	云铝股份	64,400.00	716,128.00	0.94
37	601882	海天精工	26,900.00	704,780.00	0.93
38	600519	贵州茅台	400.00	690,800.00	0.91

39	00291	华润啤酒	14,000.00	682,190.30	0.90
40	688102	斯瑞新材	36,962.00	609,503.38	0.80
41	002919	名臣健康	10,700.00	381,562.00	0.50
42	000002	万科A	20,000.00	364,000.00	0.48
43	600990	四创电子	12,200.00	363,560.00	0.48
44	603968	醋化股份	16,400.00	356,372.00	0.47
45	301115	建科股份	14,300.00	355,069.00	0.47
46	300353	东土科技	32,900.00	293,468.00	0.39
47	603309	维力医疗	6,000.00	119,880.00	0.16
48	601136	首创证券	4,739.00	82,553.38	0.11
49	001301	尚太科技	1,164.00	68,722.56	0.09

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	000301	东方盛虹	5,275,956.00	7.98
2	688032	禾迈股份	5,064,441.10	7.66
3	000032	深桑达A	4,186,971.75	6.33
4	000059	华锦股份	4,056,864.00	6.13
5	603191	望变电气	3,810,766.66	5.76
6	002245	蔚蓝锂芯	3,643,125.00	5.51
7	002895	川恒股份	3,605,425.00	5.45
8	002221	东华能源	3,479,065.48	5.26
9	601012	隆基绿能	3,364,204.60	5.09
10	000408	藏格矿业	3,271,132.00	4.94
11	300750	宁德时代	3,199,328.00	4.84
12	603931	格林达	3,197,625.00	4.83
13	300059	东方财富	3,157,781.00	4.77
14	600546	山煤国际	3,149,954.00	4.76
15	688385	复旦微电	3,083,493.65	4.66
16	300598	诚迈科技	3,028,288.00	4.58
17	603867	新化股份	2,972,853.00	4.49
18	600346	恒力石化	2,724,321.00	4.12
19	000733	振华科技	2,721,084.00	4.11
20	000792	盐湖股份	2,510,343.00	3.79
21	601628	中国人寿	2,495,022.00	3.77
22	603456	九洲药业	2,425,207.00	3.67
23	603267	鸿远电子	2,422,364.00	3.66

24	301349	信德新材	2,370,117.00	3.58
25	600256	广汇能源	2,262,473.00	3.42
26	300679	电连技术	2,216,720.00	3.35
27	000002	万 科A	2,210,077.00	3.34
28	000807	云铝股份	2,187,121.54	3.31
29	600821	金开新能	2,182,635.00	3.30
30	300274	阳光电源	2,152,351.00	3.25
31	688102	斯瑞新材	2,102,775.20	3.18
32	688111	金山办公	2,081,601.82	3.15
33	688560	明冠新材	2,052,984.97	3.10
34	300806	斯迪克	2,032,702.00	3.07
35	603185	上机数控	2,021,346.00	3.06
36	002027	分众传媒	2,003,240.00	3.03
37	002737	葵花药业	1,995,236.00	3.02
38	002129	TCL 中环	1,983,120.00	3.00
39	000001	平安银行	1,974,922.00	2.99
40	002273	水晶光电	1,969,993.00	2.98
41	000591	太阳能	1,961,364.00	2.96
42	600436	片仔癀	1,899,842.00	2.87
43	603799	华友钴业	1,877,884.00	2.84
44	600570	恒生电子	1,876,904.00	2.84
45	000975	银泰黄金	1,814,431.00	2.74
46	002558	巨人网络	1,723,363.00	2.61
47	000983	山西焦煤	1,661,649.00	2.51
48	300567	精测电子	1,653,345.00	2.50
49	000922	佳电股份	1,652,095.00	2.50
50	600519	贵州茅台	1,603,531.00	2.42
51	603163	圣晖集成	1,601,349.00	2.42
52	603713	密尔克卫	1,570,192.00	2.37
53	000690	宝新能源	1,560,029.00	2.36
54	002092	中泰化学	1,558,517.00	2.36
55	601390	中国中铁	1,550,572.00	2.34
56	000682	东方电子	1,550,029.00	2.34
57	601009	南京银行	1,547,852.00	2.34
58	601318	中国平安	1,529,930.00	2.31
59	600048	保利发展	1,525,078.00	2.31
60	688152	麒麟信安	1,513,797.95	2.29
61	300122	智飞生物	1,497,435.00	2.26
62	002050	三花智控	1,460,834.00	2.21
63	000830	鲁西化工	1,412,415.00	2.14
64	688628	优利德	1,412,088.36	2.13
65	000688	国城矿业	1,401,865.00	2.12
66	300498	温氏股份	1,400,303.00	2.12
67	300212	易华录	1,385,860.00	2.09

68	002493	荣盛石化	1,379,841.00	2.09
69	001979	招商蛇口	1,379,474.00	2.09
70	601208	东材科技	1,333,960.50	2.02
71	002594	比亚迪	1,324,366.00	2.00
72	603612	索通发展	1,323,637.00	2.00

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	300769	德方纳米	6,014,775.00	9.09
2	000301	东方盛虹	5,162,081.00	7.80
3	300750	宁德时代	4,724,525.74	7.14
4	000032	深桑达 A	4,270,669.00	6.46
5	000059	华锦股份	4,218,865.00	6.38
6	002245	蔚蓝锂芯	3,479,451.70	5.26
7	300598	诚迈科技	3,382,945.00	5.11
8	688385	复旦微电	3,330,547.16	5.03
9	002221	东华能源	3,301,589.52	4.99
10	300373	扬杰科技	3,162,412.00	4.78
11	600546	山煤国际	3,106,440.00	4.70
12	603456	九洲药业	2,895,053.00	4.38
13	002594	比亚迪	2,861,025.00	4.32
14	000408	藏格矿业	2,858,990.00	4.32
15	300207	欣旺达	2,778,749.00	4.20
16	600256	广汇能源	2,724,107.85	4.12
17	603931	格林达	2,712,180.00	4.10
18	002540	亚太科技	2,650,270.00	4.01
19	600519	贵州茅台	2,585,420.00	3.91
20	600383	金地集团	2,438,551.00	3.69
21	603876	鼎胜新材	2,399,075.00	3.63
22	600346	恒力石化	2,387,016.00	3.61
23	000792	盐湖股份	2,372,774.00	3.59
24	601012	隆基绿能	2,359,285.80	3.57
25	688111	金山办公	2,335,438.87	3.53
26	688560	明冠新材	2,261,869.77	3.42
27	300274	阳光电源	2,192,875.87	3.31
28	600875	东方电气	2,016,993.00	3.05
29	600821	金开新能	2,004,122.00	3.03

30	688005	容百科技	1,991,944.72	3.01
31	002273	水晶光电	1,986,271.00	3.00
32	603799	华友钴业	1,947,535.20	2.94
33	002737	葵花药业	1,920,320.00	2.90
34	603185	上机数控	1,890,310.00	2.86
35	002304	洋河股份	1,773,578.00	2.68
36	002895	川恒股份	1,773,030.00	2.68
37	300567	精测电子	1,751,545.00	2.65
38	300745	欣锐科技	1,685,049.00	2.55
39	000001	平安银行	1,672,479.00	2.53
40	603713	密尔克卫	1,636,041.00	2.47
41	600089	特变电工	1,631,848.00	2.47
42	002036	联创电子	1,627,852.00	2.46
43	000975	银泰黄金	1,582,166.00	2.39
44	000922	佳电股份	1,548,348.00	2.34
45	002027	分众传媒	1,539,761.00	2.33
46	000983	山西焦煤	1,533,905.00	2.32
47	688152	麒麟信安	1,526,275.08	2.31
48	002436	兴森科技	1,521,556.17	2.30
49	000002	万 科 A	1,503,237.00	2.27
50	600048	保利发展	1,502,410.00	2.27
51	000682	东方电子	1,470,376.00	2.22
52	603163	圣晖集成	1,435,823.00	2.17
53	000830	鲁西化工	1,417,936.00	2.14
54	000688	国城矿业	1,392,341.00	2.10
55	688102	斯瑞新材	1,389,502.08	2.10
56	300133	华策影视	1,389,047.00	2.10
57	002920	德赛西威	1,382,102.00	2.09
58	002558	巨人网络	1,361,495.96	2.06
59	601009	南京银行	1,351,363.00	2.04
60	601208	东材科技	1,334,678.00	2.02

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

买入股票的成本（成交）总额	270,879,256.87
卖出股票的收入（成交）总额	250,817,823.90

注：买入股票成本总额、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，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十大证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查的情形。本基金投资的前十大证券的发行主体除中国人寿(601628.SH)外,在报告编制日前一年内,没有收到公开谴责和处罚的情形。

根据中国人寿保险股份有限公司的相关公告,中国人寿保险股份有限公司因存在涉嫌违法违规行为,中国银行保险监督管理委员会及其派出机构分别于2022年1月12日、2022年1月13日、2022年1月14日、2022年1月21日、2022年1月27日、2022年1月28日、2022年2月15日、2022年2月16日、2022年2月21日、2022年2月24日、2022年2月28日、2022年3月25日、2022年4月2日、2022年4月28日、2022年6月9日、2022年7月11日、2022年7月15日、2022年7月22日、2022年8月9日、2022年8月15日、2022年8月17日、2022年9月16日、2022年9

月 29 日、2022 年 10 月 8 日、2022 年 11 月 14 日、2022 年 11 月 23 日、2022 年 12 月 6 日、2022 年 12 月 9 日对公司公开处罚，合计罚款人民币约为 830 万元。

本基金管理人认为上述事件不会对该证券的投资价值构成影响，因此也不影响基金管理人对该证券的投资决策。

8.12.2 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。

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	26,584.33
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	765.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,350.16

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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
申万菱信价值精选混合 A	3,056	32,201.62	0.00	0.00%	98,408,136.92	100.00%
申万菱信价值精选混合 C	24	15,120.43	0.00	0.00%	362,890.34	100.00%
合计	3,075	32,120.66	0.00	0.00%	98,771,027.26	100.00%

注：（1）机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，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）。

（2）若同一持有人同时持有多个类别基金份额，会存在持有人户数合计数小于各份额类别持有人户数总和的情形。

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	申万菱信价值精选混合 A	2,028,865.50	2.06%
	申万菱信价值精选混合 C	0.00	0.00%
	合计	2,028,865.50	2.05%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金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）。

9.3 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的情况

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	申万菱信价值精选混合	>100

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	A	
	申万菱信价值精选混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	申万菱信价值精选混合 A	>100
	申万菱信价值精选混合 C	0
	合计	>100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	申万菱信价值精选混合 A	申万菱信价值精选混合 C
基金合同生效日（2021 年 4 月 27 日）基金份额总额	477,935,514.24	-
本报告期期初基金份额总额	62,822,667.31	-
本报告期基金总申购份额	47,686,364.53	844,144.03
减：本报告期基金总赎回份额	12,100,894.92	481,253.69
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	98,408,136.92	362,890.34

注：1) 本基金自 2022 年 2 月 25 日起实施基金份额分级。

2) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

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、本报告期内，经基金管理人股东会决议，同意公司董事由李琦先生变更为姜山先生。
- 2、本报告期内，经基金管理人股东会决议，同意公司独立董事由白虹女士变更为马晨光女士。
- 3、本报告期内，经基金管理人股东会决议，同意公司独立董事由白硕先生变更为卓福民先生。
- 4、本报告期内，经基金管理人股东会决议，同意公司独立董事由卓福民先生变更为杨晔女士。

- 5、本报告期内，经基金管理人董事会决议，免去张丽红女士公司副总经理职务。
- 6、本报告期内，经基金管理人董事会决议，聘任史莉珠女士担任公司副总经理兼财务负责人。
- 7、本报告期内，经基金管理人董事会决议，免去王伟先生副总经理职务，聘任其为公司总经理助理。
- 8、本报告期内，基金托管人决定王霄勇任托管业务部总裁。
- 9、本报告期内，基金托管人决定王洪滨任托管业务部高级专家。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘用毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）负责基金审计事务，未发生改聘会计师事务所事宜。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7.2 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在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源证券	2	128,519,958.10	24.82%	-	-	-
恒泰证券	2	42,908,312.53	8.29%	-	-	-
长江证券	1	40,015,143.75	7.73%	-	-	-
中信建投证券	2	32,959,497.45	6.36%	-	-	-

海通证券	2	24,891,400.74	4.81%	-	-	-
国盛证券	2	24,594,084.94	4.75%	-	-	新增
招商证券	3	23,933,762.19	4.62%	-	-	-
财信证券	1	23,888,758.09	4.61%	-	-	-
中金公司	1	20,452,787.68	3.95%	-	-	-
国泰君安证券	1	15,902,477.28	3.07%	-	-	-
广发证券	2	15,589,003.00	3.01%	-	-	-
东北证券	1	14,221,748.74	2.75%	-	-	-
国海证券	1	14,145,484.55	2.73%	-	-	-
开源证券	2	13,875,795.29	2.68%	-	-	-
光大证券	2	13,633,753.00	2.63%	-	-	-
华金证券	1	13,276,700.46	2.56%	-	-	新增
华西证券	2	12,678,659.61	2.45%	-	-	-
德邦证券	2	8,529,849.70	1.65%	-	-	-
华福证券	1	8,454,635.00	1.63%	-	-	新增
兴业证券	1	7,653,431.83	1.48%	-	-	-
银河证券	2	6,123,403.00	1.18%	-	-	-
华宝证券	1	4,897,583.52	0.95%	-	-	新增
华创证券	1	3,398,258.00	0.66%	-	-	-
山西证券	2	1,705,469.84	0.33%	-	-	-
华安证券	2	1,053,672.96	0.20%	-	-	-
中信证券	1	571,604.00	0.11%	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
野村国际	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准：1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；2、公司财务状况良好；3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；4、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；5、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。

11.8.2 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		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	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-

恒泰证券	79,314.08	62.97%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	46,642.20	37.03%	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
野村国际	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

11.9 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	申万菱信价值精选混合型证券投资基金更新招募说明书（2022 年第 1 号）	中国证券报、规定互联网网站	2022-02-25
2	申万菱信价值精选混合型证券投资基金（申万菱信价值精选混合 A）产品资料概要更新	中国证券报、规定互联网网站	2022-02-25
3	申万菱信价值精选混合型证券投资基金（申万菱信价值精选混合 C）产品资料概要更新	中国证券报、规定互联网网站	2022-02-25
4	关于旗下部分基金增加 C 类基金份额并相应	中国证券报、规定互联	2022-02-23

	修订基金合同及托管协议的公告	网网站	
5	申万菱信价值精选混合型证券投资基金托管协议	中国证券报、规定互联网网站	2022-02-23
6	申万菱信价值精选混合型证券投资基金基金合同	中国证券报、规定互联网网站	2022-02-23
7	申万菱信价值精选混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-10-21
8	申万菱信价值精选混合型证券投资基金(申万菱信价值精选混合 A) 产品资料概要更新	中国证券报、规定互联网网站	2022-10-24
9	申万菱信价值精选混合型证券投资基金(申万菱信价值精选混合 C) 产品资料概要更新	中国证券报、规定互联网网站	2022-10-24
10	申万菱信价值精选混合型证券投资基金更新招募说明书(2022 年第 2 号)	中国证券报、规定互联网网站	2022-10-24

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20221114—20221231	0.00	27,302,444.37	0.00	27,302,444.37	27.64%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如投资者集中赎回，可能会给基金带来流动性冲击。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，保护持有人利益。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金新设 C 类基金份额。C 类基金份额的相关业务规则均适用本基金 A 类基金份额业务规则。详见本基金管理人发布的相关公告。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

基金合同；
 招募说明书及其更新；
 产品资料概要及其更新；
 发售公告；

成立公告；
定期报告；
其他临时公告。

13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

13.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：www.swsmu.com。

申万菱信基金管理有限公司

二〇二三年三月三十一日