

中信建投价值甄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:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:国金证券股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人国金证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月30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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	67
8.1 期末基金资产组合情况	67
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	67
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	68
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	85
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	85
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	85
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	85
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	85
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	85

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	85
8.12 投资组合报告附注	86
§9 基金份额持有人信息	86
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	86
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	87
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	87
§10 开放式基金份额变动	88
§11 重大事件揭示	88
11.1 基金份额持有人大会决议	88
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	88
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	88
11.4 基金投资策略的改变	88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	88
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	88
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	89
11.8 其他重大事件	90
§12 影响投资者决策的其他重要信息	96
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	96
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	96
§13 备查文件目录	96
13.1 备查文件目录	96
13.2 存放地点	97
13.3 查阅方式	97

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投价值甄选混合型证券投资基金	
基金简称	中信建投甄选混合	
基金主代码	008347	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年12月23日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	国金证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	348,799,264.45份	
基金合同存续期	不定期	
下属各类别基金的基金简称	中信建投甄选混合A	中信建投甄选混合C
下属各类别基金的交易代码	008347	008348
报告期末下属各类别基金的份额总额	244,941,903.43份	103,857,361.02份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用自上而下的策略，通过对宏观经济基本面（包括经济运行周期、财政及货币政策、产业政策等）的分析判断，和对流动性水平（包括资金面供需情况、证券市场估值水平等）的深入研究，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，并据此对本基金资产在股票、债券、现金之间的投资比例进行动态调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、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	中信建投基金管理有限公司		国金证券股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	朱伟		陈俐洁
	联系电话	010-59100208		021-20527198-15217
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn		chenlj@gjzq.com.cn
客户服务电话	4009-108-108		无	
传真	010-59100298		无	
注册地址	北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室		成都市青羊区东城根上街95号	
办公地址	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17、19层		四川省成都市青羊区东城根上街95号成证大厦13楼资产托管部	
邮政编码	100010		610015	
法定代表人	黄凌		冉云	

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	www.cfund108.com
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	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17、19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	
	中信建投甄选	中信建投甄选	中信建投甄选	中信建投甄选	中信建投甄选	中信建投甄选

	混合A	混合C	混合A	混合C	混合A	混合C
本期已实现收益	-10,512,384.82	-2,175,111.26	44,553,751.44	10,162,407.51	143,799,197.81	20,070,567.85
本期利润	-31,464,634.36	-8,376,005.69	40,688,197.50	7,421,356.58	150,330,660.18	20,144,414.41
加权平均基金份额本期利润	-0.1618	-0.1146	0.3817	0.3252	0.5791	0.5148
本期加权平均净值利润率	-8.56%	-6.12%	19.55%	16.94%	48.93%	41.33%
本期基金份额净值增长率	-8.55%	-8.92%	30.50%	29.98%	61.37%	60.73%
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	227,137,020.51	93,906,117.35	176,162,024.60	33,122,243.08	34,155,525.09	12,263,669.56
期末可供分配基金份额利润	0.9273	0.9042	1.1076	1.0906	0.6034	0.5968
期末基金资产净值	472,078,923.94	197,763,478.37	335,206,407.34	63,491,758.58	91,421,401.77	33,048,686.48
期末基金份额净值	1.9273	1.9042	2.1076	2.0906	1.6150	1.6084
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	92.73%	90.42%	110.76%	109.06%	61.50%	60.84%

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、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3、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。

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

中信建投甄选混合A

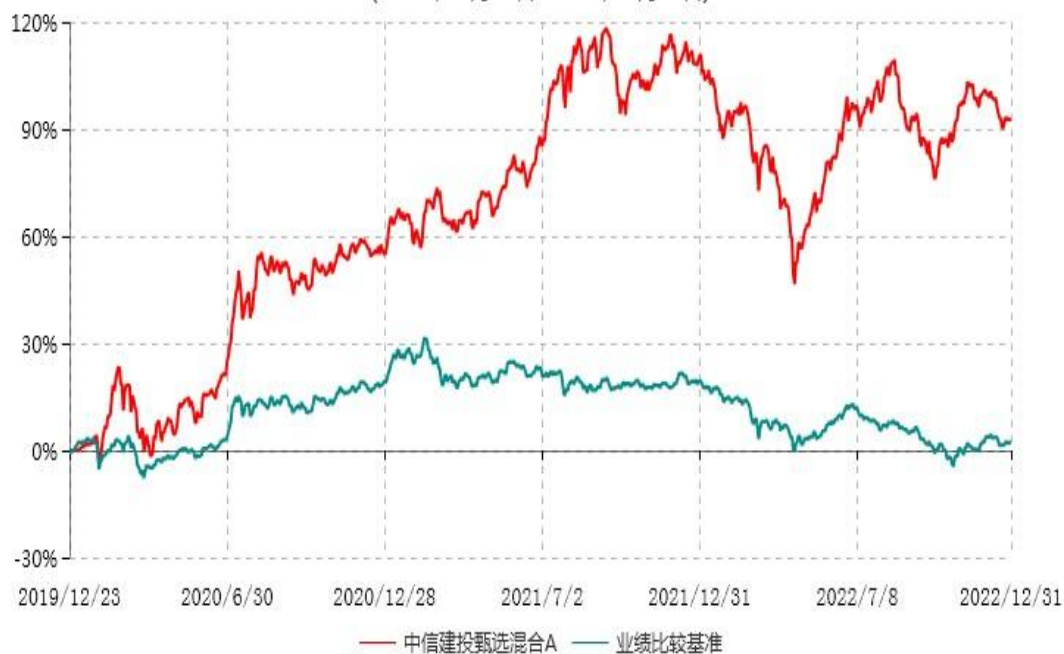
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.18%	0.93%	1.32%	0.90%	5.86%	0.03%
过去六个月	-0.79%	1.04%	-9.23%	0.77%	8.44%	0.27%
过去一年	-8.55%	1.34%	-14.49%	0.90%	5.94%	0.44%
过去三年	92.58%	1.47%	0.77%	0.91%	91.81%	0.56%
自基金合同生效起至今	92.73%	1.46%	2.28%	0.91%	90.45%	0.55%

中信建投甄选混合C

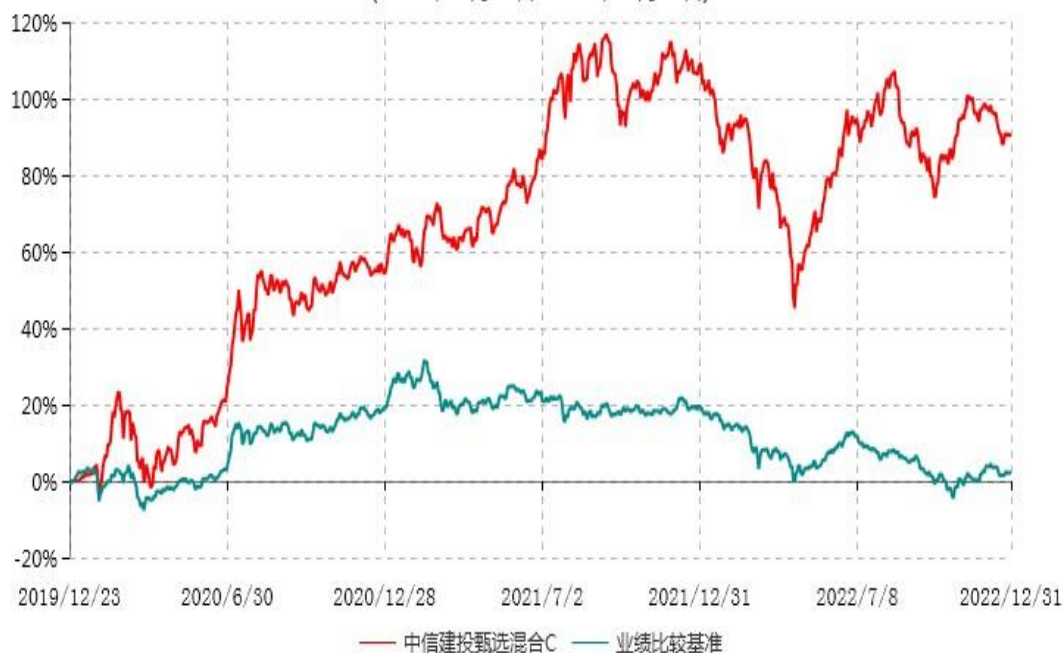
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.07%	0.93%	1.32%	0.90%	5.75%	0.03%
过去六个月	-0.98%	1.04%	-9.23%	0.77%	8.25%	0.27%
过去一年	-8.92%	1.34%	-14.49%	0.90%	5.57%	0.44%
过去三年	90.29%	1.47%	0.77%	0.91%	89.52%	0.56%
自基金合同生效起至今	90.42%	1.46%	2.28%	0.91%	88.14%	0.55%

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

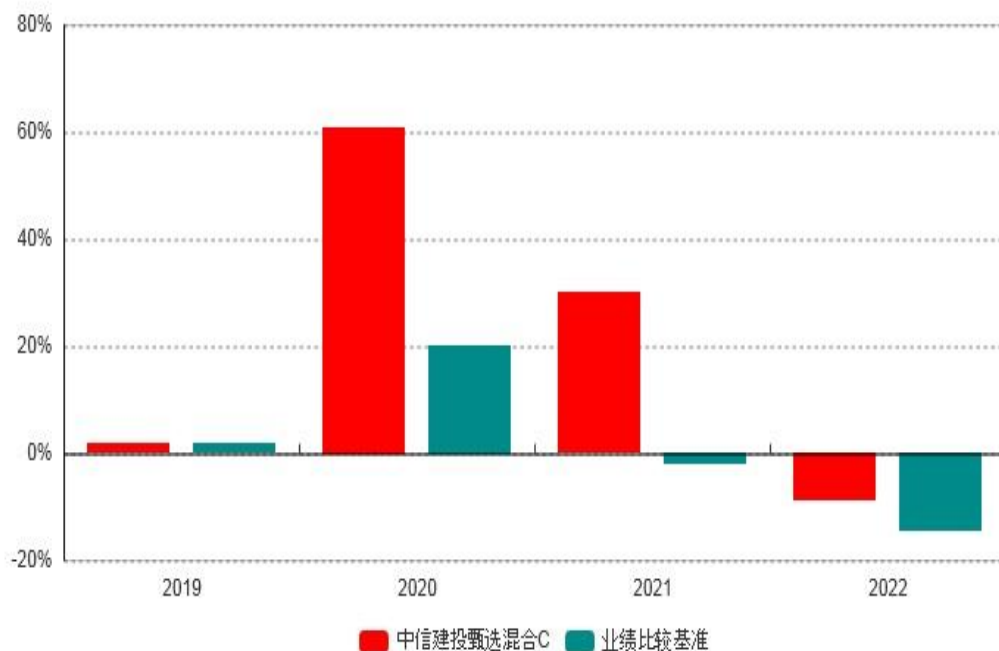
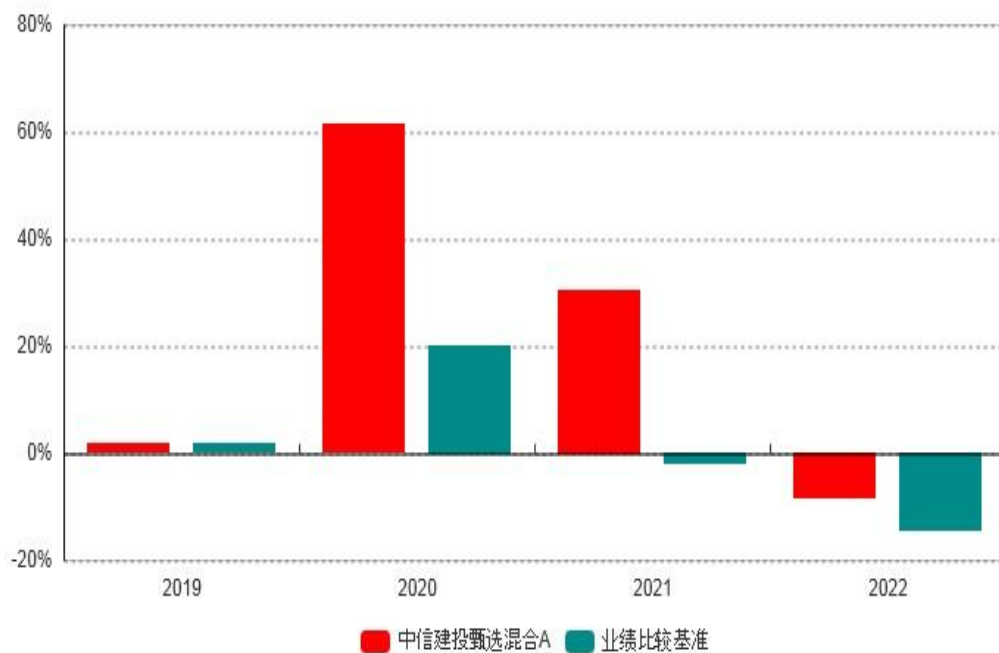
中信建投甄选混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月23日-2022年12月31日)



中信建投甄选混合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
(2019年12月23日-2022年12月31日)



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



注：基金合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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

中信建投基金管理有限公司（以下简称“中信建投基金”）于2013年9月9日在北京成立，注册资本3亿元，中信建投证券股份有限公司全资控股。中信建投基金主要经营基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。中信建投基金全资子公司元达信资本管理（北京）有限公司于2015年6月8日成立，主要经营特定客户资产管理业务和中国证监会许可的其他业务。

中信建投基金以公募基金为业务本源，以专户业务为服务抓手，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，主动投资管理能力大幅提升。同时，中信建投基金加强客户体系建设、积极拓展渠道，加大与国有大行、股份制银行、证券公司以及保险机构的合作力度。中信建投基金各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

中信建投基金作为资产管理公司，秉承“忠于信，健于投”，追求以稳健的投资，回馈于客户的信任；致力于经过长期努力，打造具有影响力的品牌。

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		
栾江伟	本基金的基金经理、权益投资一部行政负责人	2019-12-23	-	13年	中国籍，1981年7月生，北京协和医学院药物分析学硕士。曾任新华基金管理股份有限公司基金经理。2018年6月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司权益投资一部行政负责人、基金经理，担任中信建投行业轮换混合型证券投资基金、中信建投策略精选混合型证券投资基金、中信建投价值甄选混合型证券投资基金、中信建投品质

					优选一年持有期混合型 证券投资基金、中信建投 趋势领航两年持有期混 合型证券投资基金基金 经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。首任基金经理，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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。

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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中信建投基金管理有限公司公平交易管理办法》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共1次，为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

中信建投价值甄选基金坚持价值投资为主，全年业绩在偏股混合类基金中排名比较靠前，全年看，1-4月中性仓位，成长股为主，随市场调整跌幅较大，5-7月仍然是中性仓位，成长股为主，随市场反弹比较明显，8-10月市场持续调整，基金维持中性偏低仓位，期间跑赢市场，11-12月继续维持中性偏低仓位，成长股为主，彼时市场反弹主力是北上资金喜欢的医药、消费、家电、家居等，由于仓位较低，加上持仓结构不是市场热点，净值表现一般。整体上，投资坚守两个原则：一个是择时，感觉未来择时的重要性大幅上升，另一个是选股方面，重点关注行业预期差和个股的 α 机会。未来坚持行业集中度较低，个股集中度较为分散。市场赛道投资、主题投资仍然盛行，机构资金主要集中在景气度向上的热门赛道行业、游资仍然热炒各种主题。市场对行业和个股的逻辑要求越来越高，短炒越来越明显，估值重要性下降，长逻辑重要性下降，短中期逻辑重要性上升。A股和港股的投资逻辑越来越趋同，和美股逻辑也在部分靠近，A股投资当前更多的是看赛道板块小周期的景气度，长期逻辑在淡化。未来继续坚持择时和选股并重，精选行业和个股，重视个股的 α 逻辑，积极寻找个股和行业预期差，反复思考买入、卖出逻辑，对于把握性相对比较强的板块将增加配置比例，尽量减少过早的左侧交易。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投甄选混合A基金份额净值为1.9273元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.55%，同期业绩比较基准收益率为-14.49%；截至报告期末中信建投甄选混合C基金份额净值为1.9042元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.92%，同期业绩比较基准收益率为-14.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

伴随着美联储加息逐步接近尾声，全球市场流动性未来有望逐步好转，随着通胀逐步缓解，明年美国货币政策有改善空间。随着疫情防控大幅缓解，国内经济预计由衰退走向短周期复苏，货币和财政政策仍然较为宽松。2023年中国股市预计宽幅震荡，仍然是结构性机会，个股角度看，个股分化会越来越严重，对个股的深入研究越来越重要，考验的是整个投研团队的配合以及基金经理的个人能力。中长期来看，我们认为经济增速逐步下台阶是新常态，不要过分关注国内GDP增速，重点关注个股估值和业绩匹配度以及行业和个股预期差。2023年将维持中性有弹性的仓位，指数如果调整幅度较大将果断加仓，指数如果感觉有较大调整风险将果断减仓。

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，本基金管理人结合法律法规和业务发展的需要，进一步修订、完善了公司内部制度；组织多项合规培训，加强员工的风险意识和合规意识；针对投资研究等重点业务，加大检查力度，促进公司业务合法合规、稳健经营；积极参与新产品、新业务的设计，提出合规建议，对基金宣传推介、基金投资交易等方面积极开展各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、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及净值计算的复核责任。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括权益投资相关部门、固定收益部、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、风险管理部、运营管理部门的部门负责人。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策和执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中信建投价值甄选混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的约定，进行了认真的投资监督，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中信建投基金管理有限公司在中信建投价值甄选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中信建投基金管理有限公司编制和披露的中信建投价值甄选混合型证券投资基金2022年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第24527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	中信建投价值甄选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了中信建投价值甄选混合型证券投资基金(以下简称"中信建投甄选混合基金")的财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022

	<p>年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了中信建投甄选混合基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于中信建投甄选混合基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>中信建投甄选混合基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层对其他信息负责。其他信息包括中信建投甄选混合基金2022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。</p> <p>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。基于我们已经执行的工作, 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</p>

	<p>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>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中信建投甄选混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中信建投甄选混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中信建投甄选混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的</p>

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	95,645,810.85	75,164,934.27
结算备付金		3,608,312.38	5,264,051.83
存出保证金		2,461,371.77	2,604,820.95
交易性金融资产	7.4.7.2	424,436,776.54	320,552,979.46
其中：股票投资		424,436,776.54	320,282,725.46
基金投资		-	-
债券投资		-	270,254.00
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	160,107,041.10	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,758,876.00	1,523,875.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	40,295.03
资产总计		688,018,188.64	405,150,956.81
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日

负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		15,096,480.53	3,874,789.05
应付赎回款		902,687.70	690,973.02
应付管理人报酬		852,450.44	518,966.42
应付托管费		113,660.07	69,195.51
应付销售服务费		68,058.55	22,123.07
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	8.91
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,142,449.04	1,276,734.91
负债合计		18,175,786.33	6,452,790.89
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	348,799,264.45	189,413,898.24
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	321,043,137.86	209,284,267.68
净资产合计		669,842,402.31	398,698,165.92
负债和净资产总计		688,018,188.64	405,150,956.81

注：报告截止日2022年12月31日，基金份额总额348,799,264.45份，其中A类基金份额净值1.9273元，基金份额244,941,903.43份；C类基金份额净值1.9042元，基金份额103,857,361.02份。

7.2 利润表

会计主体：中信建投价值甄选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	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2022年01月01日至2022年12月31日	2021年01月01日至2021年12月31日
一、营业总收入		-30,631,963.76	60,719,492.85
1.利息收入		2,420,122.40	975,181.84
其中：存款利息收入	7.4.7.9	2,176,552.50	927,923.85
债券利息收入		-	515.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		243,569.90	46,742.50
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,203,905.04	65,238,848.49
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-9,496,344.68	63,967,495.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	13,383.88	328,799.55
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	3,279,055.76	942,553.11
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）	7.4.7.14	-27,153,143.97	-6,606,604.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	304,962.85	1,112,067.39
减：二、营业总支出		9,208,676.29	12,609,938.77
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,499,963.85	3,764,433.17

2. 托管费	7.4.10.2.2	999,995.20	501,924.36
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	538,715.32	175,089.35
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	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		1.92	1.47
8. 其他费用	7.4.7.17	170,000.00	8,168,490.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-39,840,640.05	48,109,554.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-39,840,640.05	48,109,554.08
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-39,840,640.05	48,109,554.08

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中信建投价值甄选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（基金净值）	189,413,898.24	-	209,284,267.68	398,698,165.92
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）	189,413,898.24	-	209,284,267.68	398,698,165.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	159,385,366.21	-	111,758,870.18	271,144,236.39
（一）、综合收益总额	-	-	-39,840,640.05	-39,840,640.05
（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）	159,385,366.21	-	151,599,510.23	310,984,876.44
其中：1.基金申购款	275,550,367.91	-	255,580,889.52	531,131,257.43
2.基金赎回款	-116,165,001.70	-	-103,981,379.29	-220,146,380.99
（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）	348,799,264.45	-	321,043,137.86	669,842,402.31
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）	77,155,353.59	-	47,314,734.66	124,470,088.25
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）	77,155,353.59	-	47,314,734.66	124,470,088.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	112,258,544.65	-	161,969,533.02	274,228,077.67
（一）、综合收益总额	-	-	48,109,554.08	48,109,554.08
（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）	112,258,544.65	-	113,859,978.94	226,118,523.59
其中：1.基金申购款	312,663,875.05	-	300,442,584.00	613,106,459.05
2.基金赎回款	-200,405,330.40	-	-186,582,605.06	-386,987,935.46
（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）、其他综合收益结转留	-	-	-	-

存收益				
四、本期期末净资产（基金净值）	189,413,898.24	-	209,284,267.68	398,698,165.92

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:

黄凌

谭淼

谭保民

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

中信建投价值甄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〔2019〕第2062号《关于准予中信建投价值甄选混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投价值甄选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0759号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投价值甄选混合型证券投资基金基金合同》于2019年12月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为761,921,303.76份基金份额,其中认购资金利息折合52,941.14份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司,基金托管人为国金证券股份有限公司。

根据《中信建投价值甄选混合型证券投资基金基金合同》和《中信建投价值甄选混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,但不再从本类别基金资产中计提销售服务费的一类基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用的一类基金份额,称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投价值甄选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,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、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、地方政府债券、

企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、证券公司短期融资券以及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、同业存单、股指期货、国债期货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的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的60%-95%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×70%+中证综合指数收益率×30%。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将其没有控制、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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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

新金融工具准则

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未

来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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

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

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。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。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告〔2017〕13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有

的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号一套期会计》及《企业会计准则第37号--金融工具列报》(以下合称"新金融工具准则"),财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外,财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号),中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

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

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款,金额分别为75,164,934.27元、5,264,051.83元、2,604,820.95元、40,295.03元和1,523,875.27元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款,金额分别为75,200,996.22元、5,266,657.51元、2,606,110.26元、0.00元和1,523,923.98元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为320,552,979.46元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为320,553,268.84元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款,金额分别为3,874,789.05元、690,973.02元、518,966.42元、69,195.51元、22,123.07元、1,226,039.70元和695.21元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易

费用和其他负债-其他应付款，金额分别为3,874,789.05元、690,973.02元、518,966.42元、69,195.51元、22,123.07元、1,226,039.70元和695.21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”、“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，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

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

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2012〕85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2016〕36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	95,645,810.85	75,164,934.27
等于：本金	95,565,316.68	75,164,934.27
加：应计利息	80,494.17	-
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	95,645,810.85	75,164,934.27

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	451,269,286.45	-	424,436,776.54	-26,832,509.91
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	451,269,286.45	-	424,436,776.54	-26,832,509.91
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	320,069,345.40	-	320,282,725.46	213,380.06
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	163,000.00	270,254.00	107,254.00
	银行间市场	-	-	-

	合计	163,000.00	-	270,254.00	107,254.00
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	320,232,345.40	-	320,552,979.46	320,634.06

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

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

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	160,107,041.10	-
银行间市场	-	-
合计	160,107,041.10	-
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	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

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	-	40,295.03
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	40,295.03

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	42.72	695.21
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	972,406.32	1,226,039.70
其中：交易所市场	972,406.32	1,226,039.70
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	50,000.00
合计	1,142,449.04	1,276,734.91

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 中信建投甄选混合A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投甄选混合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	159,044,382.74	159,044,382.74
本期申购	161,797,541.24	161,797,541.24
本期赎回（以“-”号填列）	-75,900,020.55	-75,900,020.55
本期末	244,941,903.43	244,941,903.43

7.4.7.7.2 中信建投甄选混合C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投甄选混合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	30,369,515.50	30,369,515.50
本期申购	113,752,826.67	113,752,826.67
本期赎回（以“-”号填列）	-40,264,981.15	-40,264,981.15
本期末	103,857,361.02	103,857,361.02

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 中信建投甄选混合A

单位：人民币元

项目 (中信建投甄选混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	186,493,746.05	-10,331,721.45	176,162,024.60
本期利润	-10,512,384.82	-20,952,249.54	-31,464,634.36
本期基金份额交易产生的变动数	91,157,000.12	-8,717,369.85	82,439,630.27
其中：基金申购款	168,695,312.45	-17,874,778.28	150,820,534.17
基金赎回款	-77,538,312.33	9,157,408.43	-68,380,903.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	267,138,361.35	-40,001,340.84	227,137,020.51

7.4.7.8.2 中信建投甄选混合C

单位：人民币元

项目 (中信建投甄选混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	35,083,956.30	-1,961,713.22	33,122,243.08
本期利润	-2,175,111.26	-6,200,894.43	-8,376,005.69
本期基金份额交易产生的变动数	77,824,972.55	-8,665,092.59	69,159,879.96

其中：基金申购款	116,855,129.78	-12,094,774.43	104,760,355.35
基金赎回款	-39,030,157.23	3,429,681.84	-35,600,475.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	110,733,817.59	-16,827,700.24	93,906,117.35

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	2,074,939.98	857,159.51
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	53,251.41	45,633.57
其他	48,361.11	25,130.77
合计	2,176,552.50	927,923.85

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	4,451,267,630.17	3,582,528,043.25
减：卖出股票成本总额	4,450,832,788.93	3,518,560,547.42
减：交易费用	9,931,185.92	-
买卖股票差价收入	-9,496,344.68	63,967,495.83

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01月01日至2022年	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年
----	-------------------------	------------------------------

	12月31日	12月31日
债券投资收益——利息收入	661.43	-
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	12,722.45	328,799.55
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	13,383.88	328,799.55

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01月01日至2022年12月 31日	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	175,877.50	1,130,840.40
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	163,000.00	801,800.00
减：应计利息总额	155.05	240.85
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	12,722.45	328,799.55

7.4.7.12 衍生工具收益

无。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022	2021年01月01日至2021

	年12月31日	年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,279,055.76	942,553.11
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,279,055.76	942,553.11

7.4.7.14 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	-27,153,143.97	-6,606,604.87
——股票投资	-27,045,889.97	-6,713,858.87
——债券投资	-107,254.00	107,254.00
——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	-27,153,143.97	-6,606,604.87

7.4.7.15 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	304,962.85	1,112,067.39
合计	304,962.85	1,112,067.39

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额中归入基金资产的比例按持有期间递减且不低于25%。

7.4.7.16 信用减值损失

无。

7.4.7.17 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	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
交易费用	-	7,998,490.42
合计	170,000.00	8,168,490.42

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

经基金管理人2021年度第六次临时股东会决议，并经中国证券监督管理委员会证监许可（2022）169号文批准，基金管理人股东航天科技财务有限责任公司将其持有的基金管理人25%的股权转让给中信建投证券股份有限公司。于2022年2月10日，基金管理人已完成前述股东变更事项的工商变更登记，本次股东变更完成后，中信建投证券股份有限公司持有基金管理人100%股权。基金管理人已于2022年2月11日在规定媒介披露上述事项。

关联方名称	与本基金的关系
航天科技财务有限责任公司	基金管理人的原股东
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
元达信资本管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
国金证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 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	
	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
国金证券 股份有限 公司	7,717,315,115.02	85.60%	6,782,631,500.73	92.86%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
国金证券 股份有限 公司	-	-	964,806.36	85.32%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：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	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
国金证券 股份有限 公司	428,000,000.00	89.54%	387,000,000.00	100.00%

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01月01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
国金证券 股份有限 公司	3,994,331.07	85.28%	727,261.68	74.79%
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
国金证券 股份有限 公司	3,467,955.19	92.61%	1,226,039.70	100.00%

注：1、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，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年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	7,499,963.85	3,764,433.17
其中：支付销售机构的客户维护费	3,070,620.28	1,831,616.62

注：支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年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	999,995.20	501,924.36

注：支付基金托管人国金证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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		
	中信建投甄选混合A	中信建投甄选混合C	合计

中信建投 基金管理 有限公司	0.00	27,488.74	27,488.74
中信建投 证券股份 有限公司	0.00	7,758.56	7,758.56
国金证券 股份有限 公司	0.00	193,148.74	193,148.74
合计	0.00	228,396.04	228,396.04
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		
	中信建投甄选混合A	中信建投甄选混合C	合计
中信建投 基金管理 有限公司	0.00	11,676.02	11,676.02
中信建投 证券股份 有限公司	0.00	3,130.36	3,130.36
国金证券 股份有限 公司	0.00	121,417.64	121,417.64
合计	0.00	136,224.02	136,224.02

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中信建投基金管理有限公司，再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日C类的基金资产净值 × 0.40% / 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

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

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

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

无。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年01月01日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信建投证券股份有限公司	001227	兰州银行	网下配售	7,868	28,088.76
中信建投证券股份有限公司	688281	华秦科技	网下配售	1,082	205,039.00
中信建投证券股份有限公司	301236	软通动力	网下配售	3,665	267,105.20
中信建投证券股份有限公司	688153	唯捷创芯	网下配售	3,541	235,830.60
国金证券股份有限公司	301212	联盛化学	网下配售	4,158	123,367.86
中信建投	603272	联翔股份	网下配售	443	6,042.52

证券股份 有限公司					
中信建投 证券股份 有限公司	688119	中钢洛耐	网下配售	33,327	168,634.62
中信建投 证券股份 有限公司	301266	宇邦新材	网下配售	5,161	138,624.46
中信建投 证券股份 有限公司	601089	福元医药	网下配售	1,749	25,570.38
中信建投 证券股份 有限公司	688322	奥比中光	网下配售	8,135	252,103.65
中信建投 证券股份 有限公司	301308	江波龙	网下配售	4,782	266,213.94
中信建投 证券股份 有限公司	001236	弘业期货	网下配售	1,399	2,602.14
国金证券 股份有限 公司	301121	紫建电子	网下配售	2,896	176,858.72
中信建投 证券股份 有限公司	688203	海正生材	网下配售	5,761	96,093.48
国金证券 股份有限 公司	688292	浩瀚深度	网下配售	4,503	74,569.68
中信建投 证券股份 有限公司	688381	帝奥微	网下配售	4,107	171,179.76
国金证券	688391	钜泉科技	网下配售	1,304	149,960.00

股份有限 公司					
上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日					
关联方名 称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张 /股）	总金额
国金证券 股份有限 公司	688210	统联精密	网下配售	2,218	94,841.68
国金证券 股份有限 公司	301096	百诚医药	网下配售	1,628	129,588.80
国金证券 股份有限 公司	301068	大地海洋	网下配售	1,436	20,075.28
国金证券 股份有限 公司	301060	兰卫医学	网下配售	5,869	24,473.73
国金证券 股份有限 公司	688091	上海谊众	网下配售	2,503	95,364.30
国金证券 股份有限 公司	688511	天微电子	网下配售	1,490	41,854.10
国金证券 股份有限 公司	605365	立达信	网下配售	645	10,945.65
国金证券 股份有限 公司	603171	税友股份	网下配售	637	8,491.21
中信建投 证券股份	688167	炬光科技	网下配售	1,323	104,106.87

有限公司					
中信建投 证券股份 有限公司	301100	风光股份	网下配售	5,012	139,383.72
中信建投 证券股份 有限公司	600927	永安期货	网下配售	1,859	33,406.23
中信建投 证券股份 有限公司	301177	迪阿股份	网下配售	2,310	269,992.80
中信建投 证券股份 有限公司	301090	华润材料	网下配售	16,358	170,941.10
中信建投 证券股份 有限公司	688553	汇宇制药	网下配售	4,642	180,434.54
中信建投 证券股份 有限公司	688697	纽威数控	网下配售	5,837	44,069.35
中信建投 证券股份 有限公司	688707	振华新材	网下配售	7,750	91,062.50
中信建投 证券股份 有限公司	688728	格科微	网下配售	6,526	93,843.88
中信建投 证券股份 有限公司	688385	复旦微电	网下配售	8,665	53,982.95
中信建投 证券股份 有限公司	300774	倍杰特	网下配售	4,435	20,267.95
中信建投 证券股份	001210	金房节能	网下配售	311	8,711.11

有限公司					
中信建投 证券股份 有限公司	301025	读客文化	网下配售	4,027	6,241.85
中信建投 证券股份 有限公司	301018	申菱环境	网下配售	7,811	64,753.19
中信建投 证券股份 有限公司	688625	呈和科技	网下配售	2,672	44,034.56
中信建投 证券股份 有限公司	603511	爱慕股份	网下配售	553	11,607.47
中信建投 证券股份 有限公司	605305	中际联合	网下配售	368	13,961.92
中信建投 证券股份 有限公司	600906	财达证券	网下配售	7,597	28,564.72
中信建投 证券股份 有限公司	300973	立高食品	网下配售	1,646	46,548.88
中信建投 证券股份 有限公司	300962	中金辐照	网下配售	5,757	19,573.80
中信建投 证券股份 有限公司	127045	牧原转债	老股东配 债	5,004	500,400.00

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

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688322	奥比中光	2022-06-30	6个月以上	科创板打新限售	30.99	21.38	8,135	252,103.65	173,926.30	-
301269	华大九天	2022-07-21	6个月以上	创业板打新限售	32.69	87.94	533	17,423.77	46,872.02	-
301327	华宝新能	2022-09-08	6个月以上	创业板打新限售	237.50	176.97	194	46,075.00	34,332.18	-
301308	江波龙	2022-07-27	6个月以上	创业板打新限售	55.67	56.72	479	26,665.93	27,168.88	-
301152	天力锂能	2022-08-19	6个月以上	创业板打新限售	57.00	46.64	419	23,883.00	19,542.16	-
301296	新巨丰	2022-08-26	6个月以上	创业板打新限售	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-
301328	维峰电子	2022-08-30	6个月以	创业板打	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-

			上	新限售						
301171	易点天下	2022-08-10	6个月以上	创业板打新限售	18.18	17.72	821	14,925.78	14,548.12	-
301121	紫建电子	2022-08-01	6个月以上	创业板打新限售	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301339	通行宝	2022-09-02	6个月以上	创业板打新限售	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67	-
301115	建科股份	2022-08-23	6个月以上	创业板打新限售	42.05	24.04	575	24,178.75	13,823.00	-
301338	凯格精机	2022-08-08	6个月以上	创业板打新限售	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301283	聚胶股份	2022-08-26	6个月以上	创业板打新限售	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301349	信德新材	2022-08-30	6个月以上	创业板打新限售	138.88	103.52	115	15,971.20	11,904.80	-
301318	维海德	2022-08-03	6个月以上	创业板打新限售	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-

301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6个月以上	创业板打新限售	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301270	汉仪股份	2022-08-19	6个月以上	创业板打新限售	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301231	荣信文化	2022-08-31	6个月以上	创业板打新限售	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301309	万得凯	2022-09-08	6个月以上	创业板打新限售	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-

注：1、根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的非公开发行股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股票，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%，且自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股票数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股票不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认

购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

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

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

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、风险管理部以及各个业务部门组成。公司实行全面、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。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险

防范和控制措施；在业务操作层面，由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

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和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。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。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人的托管账户，开立于招商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

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	上年度末
--------	-----	------

	2022年12月31日	2021年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	270,254.00
未评级	-	-
合计	-	270,254.00

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于2022年12月31日，除附注7.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(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(净资产)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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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股票不得超过该上市公司可流通股股票的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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的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上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2022年12月31日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未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。于2022年12月31日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	95,645,810.85	-	-	-	95,645,810.85
结算备付金	3,608,312.38	-	-	-	3,608,312.38
存出保证金	2,461,371.77	-	-	-	2,461,371.77
交易性金融资产	-	-	-	424,436,776.54	424,436,776.54
买入返售金融资产	160,107,041.10	-	-	-	160,107,041.10
应收申购款	-	-	-	1,758,876.00	1,758,876.00
资产总计	261,822,536.10	-	-	426,195,652.54	688,018,188.64
负债					
应付清算款	-	-	-	15,096,480.53	15,096,480.53
应付赎回款	-	-	-	902,687.70	902,687.70
应付管理人报酬	-	-	-	852,450.44	852,450.44
应付托管费	-	-	-	113,660.07	113,660.07
应付销售服务费	-	-	-	68,058.55	68,058.55
其他负债	-	-	-	1,142,449.04	1,142,449.04

负债总计	-	-	-	18,175,786.33	18,175,786.33
利率敏感度缺口	261,822,536.10	-	-	408,019,866.21	669,842,402.31
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	75,164,934.27	-	-	-	75,164,934.27
结算备付金	5,264,051.83	-	-	-	5,264,051.83
存出保证金	2,604,820.95	-	-	-	2,604,820.95
交易性金融资产	-	-	270,254.00	320,282,725.46	320,552,979.46
应收申购款	-	-	-	1,523,875.27	1,523,875.27
其他资产	-	-	-	40,295.03	40,295.03
资产总计	83,033,807.05	-	270,254.00	321,846,895.76	405,150,956.81
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,874,789.05	3,874,789.05
应付赎回款	-	-	-	690,973.02	690,973.02
应付管理人报酬	-	-	-	518,966.42	518,966.42
应付托管费	-	-	-	69,195.51	69,195.51
应付销售服务费	-	-	-	22,123.07	22,123.07
应交税费	-	-	-	8.91	8.91
其他负债	-	-	-	1,276,734.91	1,276,734.91
负债总计	-	-	-	6,452,790.89	6,452,790.89

计					
利率敏 感度缺 口	83,033,807.05	-	270,254.00	315,394,104.87	398,698,165.92

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年12月31日，本基金未持有交易性债券投资（2021年12月31日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为0.07%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2021年12月31日：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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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	424,436,776.54	63.36	320,282,725.46	80.33
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	424,436,776.54	63.36	320,282,725.46	80.33

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	37,980,514.14	16,251,255.03
	业绩比较基准下降5%	-37,980,514.14	-16,251,255.03

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	423,978,506.82	318,323,579.37
第二层次	-	9,336.49
第三层次	458,269.72	2,220,063.60
合计	424,436,776.54	320,552,979.46

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年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	-	2,220,063.60	2,220,063.60
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	663,894.55	663,894.55
转出第三层次	-	1,465,677.77	1,465,677.77

当期利得或损失总额	-	-960,010.66	-960,010.66
其中：计入损益的利得或损失	-	-960,010.66	-960,010.66
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	458,269.72	458,269.72
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	-	-103,046.15	-103,046.15
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	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,060,537.61	1,060,537.61
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	1,159,525.99	1,159,525.99
其中：计入损益的利得或损失	-	1,159,525.99	1,159,525.99
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,220,063.60	2,220,063.60
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	-	1,159,525.99	1,159,525.99

注：于2022年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2022年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资产-股票投资	458,269.72	亚式期权	预期波动率	21.27%~65.35%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资产-股票投资	2,220,063.60	亚式期权	预期波动率	24.07%~274.17%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021年12月31日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	424,436,776.54	61.69
	其中：股票	424,436,776.54	61.69
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	160,107,041.10	23.27
	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	99,254,123.23	14.43
8	其他各项资产	4,220,247.77	0.61
9	合计	688,018,188.64	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	60,458,201.00	9.03
C	制造业	235,497,142.41	35.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,602,734.00	5.61
E	建筑业	6,810,922.00	1.02
F	批发和零售业	1,593,015.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	8,608,754.00	1.29

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,733,936.37	6.53
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,689.80	0.00
L	租赁和商务服务业	28,677,436.19	4.28
M	科学研究和技术服务业	25,855.04	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,006,483.84	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	409,920.00	0.06
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	9,686.89	0.00
S	综合	-	-
	合计	424,436,776.54	63.36

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

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	600338	西藏珠峰	1,795,500	41,152,860.00	6.14
2	000785	居然之家	4,538,241	18,561,405.69	2.77
3	000513	丽珠集团	567,500	18,432,400.00	2.75
4	300181	佐力药业	1,669,700	17,815,699.00	2.66
5	000762	西藏矿业	453,100	17,494,191.00	2.61
6	300494	盛天网络	1,158,400	17,294,912.00	2.58
7	600905	三峡能源	2,776,300	15,686,095.00	2.34
8	300002	神州泰岳	3,323,300	14,423,122.00	2.15
9	002156	通富微电	834,700	13,755,856.00	2.05
10	300452	山河药辅	742,000	12,999,840.00	1.94

11	300709	精研科技	448,413	12,640,762.47	1.89
12	300054	鼎龙股份	587,300	12,503,617.00	1.87
13	600380	健康元	1,030,400	11,633,216.00	1.74
14	002466	天齐锂业	138,500	10,940,115.00	1.63
15	002176	江特电机	585,300	10,213,485.00	1.52
16	000875	吉电股份	1,506,800	9,176,412.00	1.37
17	601816	京沪高铁	1,748,900	8,604,588.00	1.28
18	600863	内蒙华电	2,458,100	8,578,769.00	1.28
19	002046	国机精工	755,900	8,367,813.00	1.25
20	000976	华铁股份	2,249,500	8,255,665.00	1.23
21	603299	苏盐井神	817,600	8,151,472.00	1.22
22	002818	富森美	636,450	7,758,325.50	1.16
23	002517	恺英网络	1,084,200	7,112,352.00	1.06
24	688089	嘉必优	133,971	6,071,565.72	0.91
25	603678	火炬电子	131,500	5,383,610.00	0.80
26	603612	索通发展	205,000	5,334,100.00	0.80
27	600328	中盐化工	345,400	5,073,926.00	0.76
28	300308	中际旭创	177,400	4,795,122.00	0.72
29	688025	杰普特	98,115	4,355,324.85	0.65
30	605287	德才股份	182,200	4,079,458.00	0.61
31	300782	卓胜微	32,500	3,714,750.00	0.55
32	688123	聚辰股份	34,065	3,447,378.00	0.51
33	601952	苏垦农发	268,600	3,180,224.00	0.47
34	688383	新益昌	32,302	3,064,813.76	0.46
35	002011	盾安环境	228,500	3,000,205.00	0.45
36	688233	神工股份	71,403	2,913,242.40	0.43
37	300533	冰川网络	115,600	2,865,724.00	0.43
38	605358	立昂微	65,100	2,773,260.00	0.41
39	601669	中国电建	385,800	2,731,464.00	0.41
40	000591	太阳能	360,500	2,642,465.00	0.39
41	688012	中微公司	25,324	2,482,005.24	0.37

42	688033	天宜上佳	109,336	2,380,244.72	0.36
43	605168	三人行	26,500	2,357,705.00	0.35
44	601678	滨化股份	437,900	2,250,806.00	0.34
45	603908	牧高笛	36,800	2,239,648.00	0.33
46	300643	万通智控	156,800	2,229,696.00	0.33
47	002166	莱茵生物	229,900	2,184,050.00	0.33
48	601238	广汽集团	181,600	2,003,048.00	0.30
49	002602	世纪华通	476,900	1,816,989.00	0.27
50	300057	万顺新材	204,800	1,814,528.00	0.27
51	002192	融捷股份	18,500	1,811,150.00	0.27
52	600557	康缘药业	93,700	1,756,875.00	0.26
53	603936	博敏电子	138,600	1,693,692.00	0.25
54	002588	史丹利	262,600	1,591,356.00	0.24
55	002873	新天药业	97,600	1,413,248.00	0.21
56	002384	东山精密	53,100	1,313,163.00	0.20
57	688517	金冠电气	113,771	1,307,228.79	0.20
58	002396	星网锐捷	64,900	1,243,484.00	0.19
59	300890	翔丰华	30,100	1,219,050.00	0.18
60	600956	新天绿能	118,800	1,145,232.00	0.17
61	000792	盐湖股份	48,100	1,091,389.00	0.16
62	002469	三维化学	176,700	1,037,229.00	0.15
63	688661	和林微纳	15,055	907,816.50	0.14
64	600989	宝丰能源	71,200	859,384.00	0.13
65	301099	雅创电子	12,400	854,732.00	0.13
66	000705	浙江震元	93,100	738,283.00	0.11
67	300554	三超新材	25,200	622,440.00	0.09
68	300757	罗博特科	9,000	471,510.00	0.07
69	300774	倍杰特	39,200	455,112.00	0.07
70	605098	行动教育	14,000	409,920.00	0.06
71	601016	节能风电	98,100	373,761.00	0.06
72	301327	华宝新能	1,934	361,887.18	0.05

73	603158	腾龙股份	49,700	352,373.00	0.05
74	300629	新劲刚	13,000	332,280.00	0.05
75	300958	建工修复	19,200	326,784.00	0.05
76	002735	王子新材	11,200	234,416.00	0.03
77	301259	艾布鲁	11,600	220,400.00	0.03
78	688401	路维光电	4,947	215,639.73	0.03
79	688380	中微半导	7,721	209,547.94	0.03
80	603306	华懋科技	4,800	179,568.00	0.03
81	688322	奥比中光	8,135	173,926.30	0.03
82	301296	新巨丰	9,111	140,191.85	0.02
83	688787	海天瑞声	1,954	116,634.26	0.02
84	301269	华大九天	533	46,872.02	0.01
85	688448	磁谷科技	1,985	46,667.35	0.01
86	301238	瑞泰新材	1,439	32,363.11	0.00
87	301308	江波龙	479	27,168.88	0.00
88	301268	铭利达	504	25,305.84	0.00
89	301117	佳缘科技	262	20,776.60	0.00
90	301152	天力锂能	419	19,542.16	0.00
91	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
92	301171	易点天下	821	14,548.12	0.00
93	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
94	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
95	301115	建科股份	575	13,823.00	0.00
96	002130	沃尔核材	2,100	13,545.00	0.00
97	301122	采纳股份	251	12,971.68	0.00
98	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
99	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
100	301349	信德新材	115	11,904.80	0.00
101	301235	华康医疗	306	10,945.62	0.00
102	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
103	688075	安旭生物	94	7,924.20	0.00

104	301237	和顺科技	261	7,707.33	0.00
105	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
106	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
107	300814	中富电路	328	5,923.68	0.00
108	300950	德固特	328	5,710.48	0.00
109	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
110	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
111	301055	张小泉	355	5,403.10	0.00
112	301081	严牌股份	403	4,650.62	0.00
113	301083	百胜智能	416	4,592.64	0.00
114	301057	汇隆新材	218	4,388.34	0.00
115	301056	森赫股份	572	4,352.92	0.00
116	603816	顾家家居	100	4,271.00	0.00
117	603056	德邦股份	200	4,166.00	0.00
118	301041	金百泽	215	4,112.95	0.00
119	301025	读客文化	403	4,082.39	0.00
120	002028	思源电气	100	3,822.00	0.00
121	301072	中捷精工	181	3,710.50	0.00
122	301068	大地海洋	144	3,536.64	0.00
123	002475	立讯精密	100	3,175.00	0.00
124	300854	中兰环保	203	3,101.84	0.00
125	301079	邵阳液压	140	2,563.40	0.00
126	600316	洪都航空	100	2,519.00	0.00
127	600216	浙江医药	200	2,338.00	0.00
128	000403	派林生物	100	2,276.00	0.00
129	002236	大华股份	200	2,262.00	0.00
130	300261	雅本化学	200	2,206.00	0.00
131	002101	广东鸿图	100	2,167.00	0.00
132	603668	天马科技	100	1,792.00	0.00
133	300707	威唐工业	100	1,544.00	0.00
134	300473	德尔股份	100	1,487.00	0.00

135	600418	江淮汽车	100	1,313.00	0.00
136	300162	雷曼光电	200	1,312.00	0.00
137	300188	美亚柏科	100	1,286.00	0.00
138	300531	优博讯	100	1,275.00	0.00
139	001979	招商蛇口	100	1,263.00	0.00
140	688238	和元生物	57	1,086.42	0.00
141	603099	长白山	100	1,086.00	0.00
142	002149	西部材料	62	1,019.28	0.00
143	300840	酷特智能	100	893.00	0.00
144	002385	大北农	100	890.00	0.00
145	600325	华发股份	80	724.80	0.00
146	002133	广宇集团	200	702.00	0.00
147	000012	南玻 A	100	671.00	0.00
148	002119	康强电子	52	594.36	0.00
149	688207	格灵深瞳	23	529.00	0.00
150	002559	亚威股份	50	361.50	0.00
151	688313	仕佳光子	39	352.95	0.00
152	688606	奥泰生物	2	208.80	0.00
153	688185	康希诺	1	146.02	0.00
154	300354	东华测试	2	76.42	0.00
155	688793	倍轻松	1	49.03	0.00
156	688611	杭州柯林	1	43.36	0.00
157	688660	电气风电	3	18.03	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	113,901,571.03	28.57
2	600338	西藏珠峰	100,400,573.65	25.18

3	002466	天齐锂业	93,312,257.00	23.40
4	300014	亿纬锂能	84,763,746.85	21.26
5	000762	西藏矿业	52,795,008.80	13.24
6	002735	王子新材	49,504,927.36	12.42
7	300059	东方财富	46,872,495.00	11.76
8	002460	赣锋锂业	44,774,411.00	11.23
9	000625	长安汽车	44,737,847.50	11.22
10	600887	伊利股份	41,824,775.00	10.49
11	600519	贵州茅台	40,376,083.00	10.13
12	300207	欣旺达	36,462,861.60	9.15
13	002192	融捷股份	36,256,954.00	9.09
14	002182	云海金属	35,961,183.29	9.02
15	000333	美的集团	35,861,673.10	8.99
16	002273	水晶光电	32,860,821.00	8.24
17	000768	中航西飞	32,747,624.00	8.21
18	300390	天华超净	31,958,333.00	8.02
19	601238	广汽集团	31,673,741.60	7.94
20	600872	中炬高新	31,620,887.11	7.93
21	002027	分众传媒	31,406,112.00	7.88
22	600905	三峡能源	31,141,925.00	7.81
23	002873	新天药业	28,690,885.58	7.20
24	688185	康希诺	27,402,228.89	6.87
25	300494	盛天网络	26,747,494.00	6.71
26	000895	双汇发展	25,554,752.00	6.41
27	000630	铜陵有色	24,883,525.25	6.24
28	002176	江特电机	24,175,481.00	6.06
29	002407	多氟多	23,910,797.74	6.00
30	002046	国机精工	23,459,675.00	5.88
31	603858	步长制药	22,643,108.00	5.68
32	000785	居然之家	22,534,809.64	5.65
33	000513	丽珠集团	22,243,004.19	5.58

34	688033	天宜上佳	22,086,595.93	5.54
35	300087	荃银高科	21,774,506.00	5.46
36	300181	佐力药业	21,241,647.00	5.33
37	600763	通策医疗	21,138,276.00	5.30
38	300782	卓胜微	21,122,011.60	5.30
39	600297	广汇汽车	20,742,787.00	5.20
40	600703	三安光电	20,164,469.00	5.06
41	300451	创业慧康	19,705,403.20	4.94
42	600141	兴发集团	19,654,997.00	4.93
43	000100	TCL科技	19,243,284.42	4.83
44	300057	万顺新材	19,215,557.52	4.82
45	600732	爱旭股份	19,183,132.00	4.81
46	002384	东山精密	18,917,759.00	4.74
47	603920	世运电路	18,782,539.00	4.71
48	601918	新集能源	18,483,491.00	4.64
49	601607	上海医药	18,463,958.00	4.63
50	000656	金科股份	18,082,103.00	4.54
51	603678	火炬电子	17,931,637.00	4.50
52	002240	盛新锂能	17,643,063.00	4.43
53	300129	泰胜风能	17,524,594.00	4.40
54	300031	宝通科技	17,324,168.04	4.35
55	601166	兴业银行	17,241,547.00	4.32
56	300709	精研科技	16,958,156.37	4.25
57	300724	捷佳伟创	16,764,500.00	4.20
58	601899	紫金矿业	16,739,735.00	4.20
59	600132	重庆啤酒	16,702,220.00	4.19
60	688661	和林微纳	16,695,974.73	4.19
61	600976	健民集团	16,589,709.00	4.16
62	688233	神工股份	16,557,951.73	4.15
63	688378	奥来德	16,490,680.86	4.14
64	600704	物产中大	16,356,587.00	4.10

65	300002	神州泰岳	16,116,135.00	4.04
66	300629	新劲刚	15,871,139.60	3.98
67	600760	中航沈飞	15,406,653.00	3.86
68	601390	中国中铁	15,303,927.00	3.84
69	002156	通富微电	15,195,474.00	3.81
70	002756	永兴材料	15,190,218.00	3.81
71	603936	博敏电子	15,164,523.00	3.80
72	000400	许继电气	14,908,608.00	3.74
73	002635	安洁科技	14,906,312.00	3.74
74	002011	盾安环境	14,734,923.85	3.70
75	688598	金博股份	14,485,758.52	3.63
76	002166	莱茵生物	14,339,649.00	3.60
77	601598	中国外运	14,270,906.82	3.58
78	000776	广发证券	14,093,463.00	3.53
79	300263	隆华科技	13,975,754.00	3.51
80	603690	至纯科技	13,927,433.00	3.49
81	603228	景旺电子	13,781,875.26	3.46
82	601155	新城控股	13,756,206.57	3.45
83	000807	云铝股份	13,732,775.00	3.44
84	300054	鼎龙股份	13,710,240.00	3.44
85	300699	光威复材	13,672,494.00	3.43
86	600380	健康元	13,509,271.00	3.39
87	000989	九芝堂	13,456,590.00	3.38
88	000623	吉林敖东	13,298,985.00	3.34
89	000591	太阳能	13,286,145.00	3.33
90	600259	广晟有色	13,153,822.00	3.30
91	600702	舍得酒业	13,034,508.00	3.27
92	301050	雷电微力	12,828,245.00	3.22
93	688200	华峰测控	12,790,833.30	3.21
94	301071	力量钻石	12,764,599.00	3.20
95	002191	劲嘉股份	12,706,422.72	3.19

96	300799	左江科技	12,650,461.00	3.17
97	000927	中国铁物	12,589,039.00	3.16
98	601126	四方股份	12,520,959.00	3.14
99	000537	广宇发展	12,468,344.00	3.13
100	002475	立讯精密	12,324,084.00	3.09
101	002074	国轩高科	12,308,837.00	3.09
102	600587	新华医疗	12,184,276.97	3.06
103	601633	长城汽车	12,140,289.00	3.04
104	000875	吉电股份	12,138,100.00	3.04
105	002412	汉森制药	12,134,489.00	3.04
106	600497	驰宏锌锗	12,111,175.00	3.04
107	603439	贵州三力	12,093,774.42	3.03
108	300229	拓尔思	11,999,631.00	3.01
109	605358	立昂微	11,981,038.00	3.01
110	300452	山河药辅	11,978,550.00	3.00
111	600893	航发动力	11,932,800.00	2.99
112	301206	三元生物	11,873,526.94	2.98
113	300355	蒙草生态	11,858,941.00	2.97
114	600399	抚顺特钢	11,848,827.00	2.97
115	000338	潍柴动力	11,708,400.00	2.94
116	600166	福田汽车	11,686,700.00	2.93
117	000792	盐湖股份	11,683,276.00	2.93
118	600219	南山铝业	11,449,725.00	2.87
119	600863	内蒙华电	11,432,578.00	2.87
120	600773	西藏城投	11,414,581.00	2.86
121	300415	伊之密	11,394,421.00	2.86
122	000976	华铁股份	11,348,029.04	2.85
123	002568	百润股份	11,239,235.60	2.82
124	002345	潮宏基	11,213,343.00	2.81
125	600809	山西汾酒	11,202,977.00	2.81
126	300296	利亚德	10,789,316.13	2.71

127	688711	宏微科技	10,700,009.60	2.68
128	000423	东阿阿胶	10,699,239.90	2.68
129	000090	天健集团	10,668,304.50	2.68
130	600690	海尔智家	10,656,064.00	2.67
131	002241	歌尔股份	10,635,695.00	2.67
132	600179	安通控股	10,573,811.00	2.65
133	002432	九安医疗	10,431,369.49	2.62
134	002517	恺英网络	10,240,618.00	2.57
135	002304	洋河股份	10,189,363.00	2.56
136	688089	嘉必优	10,156,629.48	2.55
137	300224	正海磁材	10,121,548.00	2.54
138	600755	厦门国贸	10,061,024.00	2.52
139	000725	京东方 A	9,933,029.00	2.49
140	600456	宝钛股份	9,875,161.00	2.48
141	603369	今世缘	9,855,435.00	2.47
142	688575	亚辉龙	9,812,490.23	2.46
143	688072	拓荆科技	9,761,606.37	2.45
144	002352	顺丰控股	9,742,874.00	2.44
145	300893	松原股份	9,546,524.25	2.39
146	300409	道氏技术	9,538,195.00	2.39
147	002230	科大讯飞	9,305,238.00	2.33
148	601816	京沪高铁	9,227,096.00	2.31
149	601866	中远海发	9,223,520.00	2.31
150	603299	苏盐井神	9,048,145.00	2.27
151	000961	中南建设	8,959,461.00	2.25
152	002044	美年健康	8,930,105.00	2.24
153	600730	中国高科	8,924,851.48	2.24
154	688068	热景生物	8,884,661.28	2.23
155	600313	农发种业	8,871,981.00	2.23
156	601005	重庆钢铁	8,845,351.00	2.22
157	600307	酒钢宏兴	8,842,973.00	2.22

158	600919	江苏银行	8,841,323.00	2.22
159	600958	东方证券	8,837,956.00	2.22
160	688012	中微公司	8,767,773.36	2.20
161	688025	杰普特	8,661,538.99	2.17
162	002286	保龄宝	8,591,288.00	2.15
163	688778	厦钨新能	8,545,621.48	2.14
164	300745	欣锐科技	8,533,376.00	2.14
165	688425	铁建重工	8,490,712.80	2.13
166	600022	山东钢铁	8,474,124.40	2.13
167	603937	丽岛新材	8,425,099.70	2.11
168	603986	兆易创新	8,191,747.96	2.05
169	300674	宇信科技	8,190,362.00	2.05
170	002101	广东鸿图	8,169,176.00	2.05
171	600938	中国海油	8,146,676.36	2.04
172	000933	神火股份	8,144,238.00	2.04
173	600125	铁龙物流	8,126,212.00	2.04
174	600808	马钢股份	8,079,808.00	2.03
175	600159	大龙地产	8,033,074.00	2.01

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	111,561,941.20	27.98
2	300014	亿纬锂能	83,917,547.00	21.05
3	002466	天齐锂业	75,647,750.50	18.97
4	600338	西藏珠峰	53,311,923.71	13.37
5	002460	赣锋锂业	44,626,403.00	11.19
6	300059	东方财富	44,429,789.00	11.14
7	000625	长安汽车	43,644,616.97	10.95
8	688185	康希诺	42,594,770.40	10.68

9	002735	王子新材	41,672,074.40	10.45
10	600887	伊利股份	40,370,551.00	10.13
11	600519	贵州茅台	40,039,633.00	10.04
12	000333	美的集团	34,822,000.70	8.73
13	300207	欣旺达	34,795,836.18	8.73
14	600872	中炬高新	33,615,222.90	8.43
15	300390	天华超净	33,196,647.00	8.33
16	002873	新天药业	33,035,268.16	8.29
17	002182	云海金属	32,807,332.00	8.23
18	002192	融捷股份	32,203,391.94	8.08
19	000762	西藏矿业	31,597,406.17	7.93
20	002273	水晶光电	31,468,287.66	7.89
21	601238	广汽集团	31,085,556.00	7.80
22	002027	分众传媒	30,773,290.44	7.72
23	000768	中航西飞	30,647,125.55	7.69
24	603858	步长制药	28,156,854.59	7.06
25	002407	多氟多	27,494,321.58	6.90
26	000630	铜陵有色	25,048,986.85	6.28
27	000895	双汇发展	23,687,416.00	5.94
28	600763	通策医疗	23,612,698.00	5.92
29	600732	爱旭股份	23,176,438.00	5.81
30	688233	神工股份	23,160,655.20	5.81
31	300087	荃银高科	23,089,090.14	5.79
32	688033	天宜上佳	22,299,489.98	5.59
33	688598	金博股份	21,465,966.63	5.38
34	600297	广汇汽车	21,462,896.45	5.38
35	300451	创业慧康	20,877,785.50	5.24
36	600703	三安光电	20,671,368.00	5.18
37	300629	新劲刚	20,654,977.55	5.18
38	600141	兴发集团	19,942,897.00	5.00
39	000656	金科股份	18,860,549.00	4.73

40	600132	重庆啤酒	18,511,617.99	4.64
41	000100	TCL科技	18,482,966.22	4.64
42	002384	东山精密	18,481,062.00	4.64
43	601155	新城控股	18,162,546.00	4.56
44	300129	泰胜风能	18,043,029.00	4.53
45	601633	长城汽车	17,949,436.00	4.50
46	688661	和林微纳	17,863,206.01	4.48
47	601607	上海医药	17,764,557.00	4.46
48	300031	宝通科技	17,717,282.18	4.44
49	300782	卓胜微	17,655,905.00	4.43
50	300724	捷佳伟创	17,640,320.48	4.42
51	603920	世运电路	17,363,990.80	4.36
52	000400	许继电气	17,280,954.00	4.33
53	601166	兴业银行	17,184,908.00	4.31
54	600976	健民集团	16,897,541.00	4.24
55	600893	航发动力	16,811,747.10	4.22
56	601899	紫金矿业	16,268,229.00	4.08
57	601390	中国中铁	15,960,778.00	4.00
58	600704	物产中大	15,701,932.00	3.94
59	300057	万顺新材	15,643,753.00	3.92
60	002756	永兴材料	15,575,286.00	3.91
61	600905	三峡能源	15,416,439.00	3.87
62	000927	中国铁物	15,297,145.00	3.84
63	300699	光威复材	15,221,493.00	3.82
64	601918	新集能源	15,148,427.00	3.80
65	002559	亚威股份	15,007,809.00	3.76
66	000807	云铝股份	14,899,301.00	3.74
67	002635	安洁科技	14,862,503.00	3.73
68	600760	中航沈飞	14,787,303.31	3.71
69	300019	硅宝科技	14,492,000.00	3.63
70	002240	盛新锂能	14,450,600.00	3.62

71	002568	百润股份	14,263,251.00	3.58
72	002412	汉森制药	14,261,239.00	3.58
73	002533	金杯电工	14,083,432.70	3.53
74	300415	伊之密	14,083,186.00	3.53
75	601598	中国外运	13,782,911.00	3.46
76	603936	博敏电子	13,665,323.00	3.43
77	688378	奥来德	13,643,552.58	3.42
78	600702	舍得酒业	13,629,630.00	3.42
79	600587	新华医疗	13,623,233.14	3.42
80	601126	四方股份	13,435,176.00	3.37
81	300893	松原股份	13,433,015.00	3.37
82	002255	海陆重工	13,329,834.00	3.34
83	000776	广发证券	13,275,374.00	3.33
84	603678	火炬电子	13,148,904.00	3.30
85	688200	华峰测控	13,125,797.36	3.29
86	600456	宝钛股份	13,054,156.00	3.27
87	000537	广宇发展	12,963,556.00	3.25
88	603439	贵州三力	12,954,600.00	3.25
89	600497	驰宏锌锗	12,950,857.00	3.25
90	600755	厦门国贸	12,745,735.89	3.20
91	300799	左江科技	12,694,909.00	3.18
92	301050	雷电微力	12,679,792.00	3.18
93	002230	科大讯飞	12,545,902.93	3.15
94	603228	景旺电子	12,517,778.94	3.14
95	002011	盾安环境	12,491,954.90	3.13
96	600166	福田汽车	12,381,129.00	3.11
97	000989	九芝堂	12,304,290.00	3.09
98	300355	蒙草生态	12,281,692.00	3.08
99	600809	山西汾酒	12,180,519.00	3.06
100	000591	太阳能	12,129,827.00	3.04
101	000423	东阿阿胶	12,085,104.00	3.03

102	300041	回天新材	12,004,874.99	3.01
103	301071	力量钻石	11,950,547.00	3.00
104	688072	拓荆科技	11,949,830.63	3.00
105	002475	立讯精密	11,846,240.00	2.97
106	603690	至纯科技	11,655,114.60	2.92
107	600690	海尔智家	11,654,608.00	2.92
108	000922	佳电股份	11,613,723.00	2.91
109	002046	国机精工	11,553,274.74	2.90
110	002166	莱茵生物	11,485,929.00	2.88
111	300263	隆华科技	11,479,579.00	2.88
112	000012	南玻 A	11,264,623.00	2.83
113	600259	广晟有色	11,230,655.21	2.82
114	000338	潍柴动力	11,206,403.00	2.81
115	002074	国轩高科	11,188,541.00	2.81
116	300229	拓尔思	11,143,667.00	2.80
117	000792	盐湖股份	10,745,912.00	2.70
118	000090	天健集团	10,710,238.00	2.69
119	301206	三元生物	10,674,695.00	2.68
120	002101	广东鸿图	10,652,124.00	2.67
121	600773	西藏城投	10,523,991.00	2.64
122	002432	九安医疗	10,519,949.00	2.64
123	002345	潮宏基	10,468,905.00	2.63
124	000623	吉林敖东	10,442,610.00	2.62
125	688711	宏微科技	10,416,040.44	2.61
126	002176	江特电机	10,404,959.00	2.61
127	600219	南山铝业	10,224,029.00	2.56
128	300224	正海磁材	10,218,297.00	2.56
129	600179	安通控股	10,167,879.00	2.55
130	688425	铁建重工	9,934,756.44	2.49
131	300494	盛天网络	9,924,616.00	2.49
132	688575	亚辉龙	9,912,953.42	2.49

133	600399	抚顺特钢	9,871,165.00	2.48
134	002241	歌尔股份	9,835,943.00	2.47
135	688003	天准科技	9,739,503.97	2.44
136	605358	立昂微	9,723,404.00	2.44
137	600795	国电电力	9,692,531.00	2.43
138	300296	利亚德	9,676,297.00	2.43
139	600307	酒钢宏兴	9,662,119.00	2.42
140	603369	今世缘	9,648,024.75	2.42
141	300409	道氏技术	9,591,691.00	2.41
142	603937	丽岛新材	9,569,782.34	2.40
143	000961	中南建设	9,401,812.00	2.36
144	002304	洋河股份	9,386,302.00	2.35
145	000725	京东方 A	9,359,768.00	2.35
146	002352	顺丰控股	9,340,884.00	2.34
147	300745	欣锐科技	9,324,102.00	2.34
148	600730	中国高科	9,290,400.00	2.33
149	688778	厦钨新能	9,158,232.72	2.30
150	601985	中国核电	9,097,144.82	2.28
151	601005	重庆钢铁	9,066,520.00	2.27
152	000933	神火股份	9,014,026.00	2.26
153	603517	绝味食品	8,903,406.00	2.23
154	002044	美年健康	8,873,640.50	2.23
155	600958	东方证券	8,815,758.00	2.21
156	600919	江苏银行	8,670,740.00	2.17
157	688068	热景生物	8,641,018.86	2.17
158	600125	铁龙物流	8,566,450.00	2.15
159	600808	马钢股份	8,557,325.00	2.15
160	301236	软通动力	8,557,175.81	2.15
161	600313	农发种业	8,548,770.00	2.14
162	002191	劲嘉股份	8,529,981.00	2.14
163	600022	山东钢铁	8,491,282.29	2.13

164	002286	保龄宝	8,208,836.00	2.06
165	301266	宇邦新材	8,157,973.68	2.05
166	601866	中远海发	8,145,366.00	2.04
167	603396	金辰股份	8,137,980.00	2.04
168	003031	中瓷电子	8,098,518.00	2.03
169	000157	中联重科	8,079,988.00	2.03
170	600869	远东股份	8,079,434.00	2.03
171	002171	楚江新材	8,012,539.00	2.01

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	4,582,032,729.98
卖出股票收入（成交）总额	4,451,267,630.17

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票未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	2,461,371.77
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,758,876.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,220,247.77

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

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	持有	户均持有	持有人结构
----	----	------	-------

级别	人户数 (户)	的基金份额	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
中信建投 甄选 混合 A	6,499	37,689.17	42,244,732.93	17.2468%	202,697,170.50	82.7532%
中信建投 甄选 混合C	3,560	29,173.42	58,969,721.04	56.7795%	44,887,639.98	43.2205%
合计	9,869	35,342.92	101,214,453.97	29.0180%	247,584,810.48	70.9820%

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	中信建投甄选混合A	60,742.73	0.0248%
	中信建投甄选混合C	20,304.28	0.0196%
	合计	81,047.01	0.0232%

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	中信建投甄选混合A	0
	中信建投甄选混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	中信建投甄选混合A	0
	中信建投甄选混合C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投甄选混合A	中信建投甄选混合C
基金合同生效日(2019年12月23日)基金份额总额	688,497,964.07	73,423,339.69
本报告期期初基金份额总额	159,044,382.74	30,369,515.50
本报告期基金总申购份额	161,797,541.24	113,752,826.67
减：本报告期基金总赎回份额	75,900,020.55	40,264,981.15
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	244,941,903.43	103,857,361.02

§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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金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

报告期内应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用50,000.00元整，该审计机构自2019年12月23日（基金合同生效日）为本基金提供审计服务。

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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方财富证券	1	609,800,992.11	6.76%	323,982.97	6.92%	-
东吴证券	1	688,058,053.62	7.63%	365,558.89	7.80%	-
国金证券	3	7,717,315,115.02	85.60%	3,994,331.07	85.28%	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字〔2007〕48号）的规定及本基金管理人的《中信建投基金管理有限公司公募基金交易单元管理办法》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）证券经纪商的选择由公司权益投资相关部门负责人根据证券经纪商投资研究服务综合评价，作出交易单元开设或撤销的相关决定。经公司分管领导通过后，方可办理相关的交易单元开设或撤销事宜。

（2）权益投资相关部门每季度组织相关部门完成对各往来证券经纪商的研究服务评估。权益投资相关部门根据评估结果调整确定个别证券经纪商的交易金额及比率限制的参考。

（3）评估实行评分制，具体如下：

分配权重（100分）=基础研究服务（70%）+综合研究服务（20%）+特别研究服务（10%）。基础研究服务占70%权重和综合研究服务占20%权重，由权益投资相关部门组织投研条线相关人员进行打分；特别研究服务占10%权重，由系统跟踪股票涨跌幅后生成得分。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

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
东方财富证券	-	-	50,000,000.00	10.46%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	428,000,000.00	89.54%	-	-	-	-

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	中信建投基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	规定网站、规定报刊	2022-01-05
2	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-01-08
3	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票及相关风险提示的公告	规定网站、规定报刊	2022-01-20
4	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2021年第4季度报告提示性公告	规定报刊	2022-01-24
5	中信建投价值甄选混合型证券投资基金2021年第4季度报告	规定网站	2022-01-24

6	中信建投基金管理有限公司 关于公司股东变更的公告	规定网站、规定报刊	2022-01-27
7	中信建投基金管理有限公司 关于完成股东变更工商变更 登记的公告	规定网站、规定报刊	2022-02-11
8	关于中信建投基金管理有限 公司旗下部分基金增加鼎信 汇金（北京）投资管理有限 公司为代销机构并开通定期 定额投资业务及开展费率优 惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-02-17
9	关于中信建投基金管理有限 公司旗下部分基金增加上海 万得基金销售有限公司为代 销机构并开通定期定额投资 业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-02-23
10	中信建投基金管理有限公司 关于旗下部分基金投资关联 方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-03-02
11	中信建投基金管理有限公司 关于旗下部分基金投资关联 方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-03-10
12	关于中信建投基金管理有限 公司旗下部分基金在国金证 券股份有限公司调整申购及 定投起点金额并开展费率优 惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2022-03-15
13	中信建投基金管理有限公司 旗下部分基金2021年年度报 告提示性公告	规定报刊	2022-03-31
14	中信建投价值甄选混合型证 券投资基金2021年年度报告	规定网站	2022-03-31
15	中信建投基金管理有限公司	规定网站、规定报刊	2022-04-02

	关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告		
16	关于中信建投价值甄选混合型证券投资基金增加部分代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-04-08
17	关于中信建投价值甄选混合型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-04-09
18	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年第1季度报告提示性公告	规定报刊	2022-04-22
19	中信建投价值甄选混合型证券投资基金2022年第1季度报告	规定网站	2022-04-22
20	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加中国人寿保险股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-04-28
21	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加招商银行股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-05-10
22	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-05-13
23	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加交通银行股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资及开展费率优惠业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-05-17
24	关于中信建投基金管理有限公司	规定网站、规定报刊	2022-05-19

	公司旗下部分基金增加上海攀赢基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资及开展费率优惠业务的公告		
25	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-05-28
26	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加青岛意才基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资及开展费率优惠业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-05-30
27	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在中信建投证券股份有限公司调整定投起点金额的公告	规定网站、规定报刊	2022-05-31
28	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-06-01
29	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-06-15
30	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-06-25
31	关于中信建投价值甄选混合型证券投资基金增加中国银河证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-06-30
32	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-02

33	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加平安银行股份有限公司为代销机构及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-14
34	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年第2季度报告提示性公告	规定报刊	2022-07-21
35	中信建投价值甄选混合型证券投资基金2022年第2季度报告	规定网站	2022-07-21
36	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-29
37	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-29
38	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-30
39	关于中信建投价值甄选混合型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-03
40	关于中信建投价值甄选混合型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-11
41	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-11
42	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-17

43	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加北京中植基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-19
44	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加北京格上富信基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资及开展费率优惠业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-24
45	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加海通证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资及开展费率优惠业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-25
46	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年中期报告提示性公告	规定报刊	2022-08-31
47	中信建投价值甄选混合型证券投资基金2022年中期报告	规定网站	2022-08-31
48	关于中信建投价值甄选混合型证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-09-07
49	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加招商证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-09-21
50	中信建投价值甄选混合型证券投资基金招募说明书（更新）	规定网站	2022-09-23
51	中信建投价值甄选混合型证券投资基金基金产品资料概	规定网站	2022-09-23

	要更新		
52	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加北京创金启富基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-10-20
53	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年第3季度报告提示性公告	规定报刊	2022-10-26
54	中信建投价值甄选混合型证券投资基金2022年第3季度报告	规定网站	2022-10-26
55	关于中信建投基金管理有限公司旗下基金在销售机构开通定投业务、定投起点金额及申购费率优惠业务的提示性公告	规定网站、规定报刊	2022-11-01

§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

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，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、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投价值甄选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投价值甄选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、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。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司
二〇二三年三月三十一日