

中银主题策略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：中银基金管理有限公司
基金托管人：广发银行股份有限公司
报告送出日期：二〇二三年三月三十日

§ 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。

基金托管人广发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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（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
§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	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	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.....	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.....	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
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.....	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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.....	18
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	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	22
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况.....	58
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	58
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	69
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	69
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	69
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	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
8.12 投资组合报告附注	70
§9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	71
§10 开放式基金份额变动	72
§11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	74
§12 备查文件目录	79
12.1 备查文件目录	79
12.2 存放地点	79
12.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银主题策略混合型证券投资基金	
基金简称	中银主题策略混合	
基金主代码	163822	
交易代码	163822	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 7 月 25 日	
基金管理人	中银基金管理有限公司	
基金托管人	广发银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	588,909,220.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中银主题策略混合 A	中银主题策略混合 C
下属分级基金的交易代码	163822	015386
报告期末下属分级基金的份 额总额	460,313,770.39 份	128,595,449.62 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以主题投资为核心, 充分把握驱动中国经济发展和结构转型带来的主题性投资机会, 并精选获益程度高的主题个股进行投资。在严格控制风险的前提下, 力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势, 判断当前所处的经济周期, 结合对流动性及资金流向的分析, 综合股市和债市估值及风险分析进行大类资产配置。其次, 基于自上而下的投资主题框架, 综合运用定量和定性的分析方法, 针对经济发展趋势及成长动因进行前瞻性的分析, 挖掘市场的长期性和阶段性主题投资机会, 精选与投资主题相符的行业和具有核心竞争力的上市公司进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 ×80%+ 上证国债指数收益率

	×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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		中银基金管理有限公司	广发银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	欧阳向军	顾洪峰
	联系电话	021-38848999	010-65169885
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	guhongfeng@cgbchina.com.cn
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	4008308003
传真		021-68873488	010-65169555
注册地址		上海市银城中路200号中银大厦45层	广东省广州市越秀区东风东路713号
办公地址		上海市银城中路200号中银大厦10层、11层、26层、45层	北京市东城区东长安街甲2号广发银行大厦
邮政编码		200120	100005
法定代表人		章砚	王凯

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bocim.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 200 号 26 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公	北京市西城区太平桥大街 17

	司	号
--	---	---

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年		2021 年		2020 年	
	中银主题策略混合 A	中银主题策略混合 C	中银主题策略混合 A	中银主题策略混合 C	中银主题策略混合 A	中银主题策略混合 C
本期已实现收益	-185,351,967.84	-31,308,336.11	114,837,838.85	-	154,075,499.83	-
本期利润	-167,205,360.03	-42,119,191.64	99,928,967.53	-	182,089,755.53	-
加权平均基金份额本期利润	-0.6612	-0.6416	0.9703	-	1.2798	-
本期加权平均净值利润率	-16.96%	-16.37%	24.99%	-	48.20%	-
本期基金份额净值增长率	-14.69%	0.61%	32.15%	-	64.33%	-
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	中银主题策略混合 A	中银主题策略混合 C	中银主题策略混合 A	中银主题策略混合 C	中银主题策略混合 A	中银主题策略混合 C
期末可供分配利润	705,783,011.30	195,719,085.73	377,351,916.71	-	124,935,730.29	-
期末可供分配基金份额利润	1.5333	1.5220	2.2582	-	1.1111	-
期末基金资产净值	1,743,362,642.44	485,511,579.20	741,778,952.72	-	377,681,529.23	-
期末基金份额净值	3.787	3.775	4.439	-	3.359	-
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	中银主题策略混合 A	中银主题策略混合 C	中银主题策略混合 A	中银主题策略混合 C	中银主题策略混合 A	中银主题策略混合 C
基金份额累计	293.01%	0.61%	360.67%	-	248.59%	-

净值增长率						
-------	--	--	--	--	--	--

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

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）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（已实现部分扣除未实现部分）。

3.本基金 C 类份额自 2022 年 3 月 16 日起生效，截至报告期末生效未满三年。

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. 中银主题策略混合 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.66%	1.10%	1.55%	1.03%	0.11%	0.07%
过去六个月	-10.81%	1.17%	-10.71%	0.89%	-0.10%	0.28%
过去一年	-14.69%	1.40%	-16.86%	1.03%	2.17%	0.37%
过去三年	85.27%	1.55%	-1.24%	1.04%	86.51%	0.51%
过去五年	79.48%	1.47%	2.69%	1.04%	76.79%	0.43%
自基金合同生效日起	293.01%	1.72%	66.67%	1.14%	226.34%	0.58%

2. 中银主题策略混合 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.56%	1.10%	1.55%	1.03%	0.01%	0.07%
过去六个	-10.99%	1.16%	-10.71%	0.89%	-0.28%	0.27%

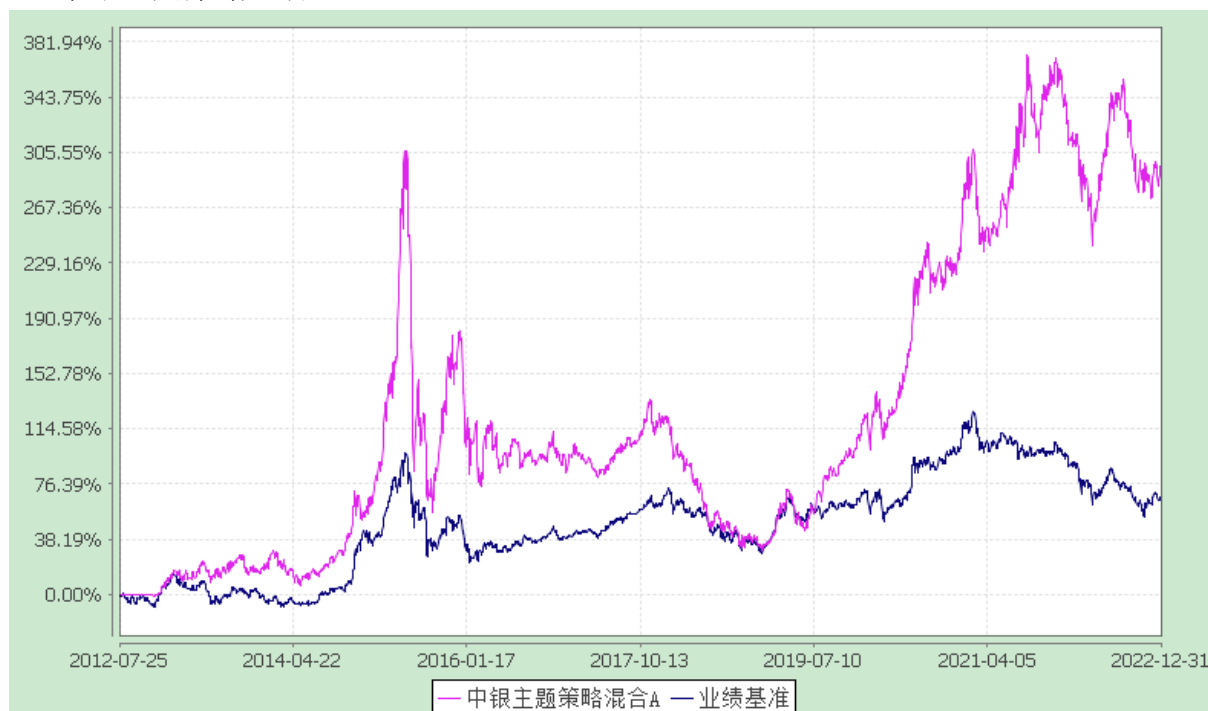
月						
自基金合同生效日起	0.61%	1.36%	-1.48%	1.01%	2.09%	0.35%

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

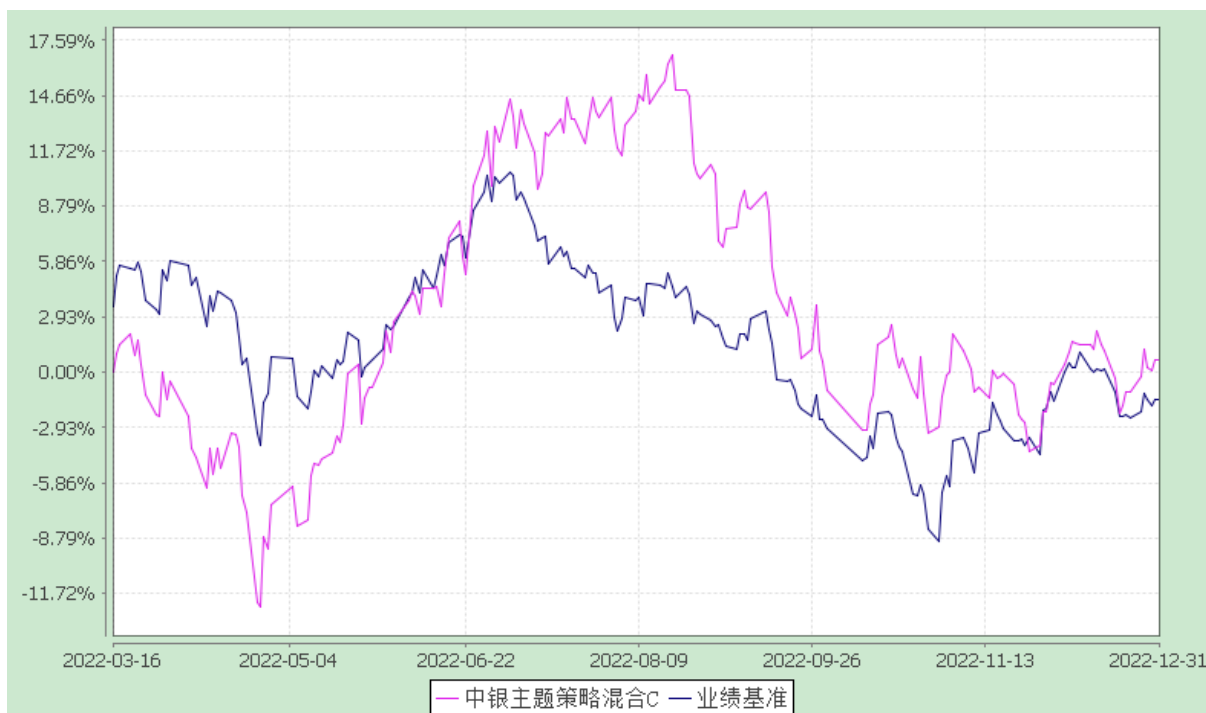
中银主题策略混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金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
(2012 年 7 月 25 日至 2022 年 12 月 31 日)

1、中银主题策略混合 A



2、中银主题策略混合 C



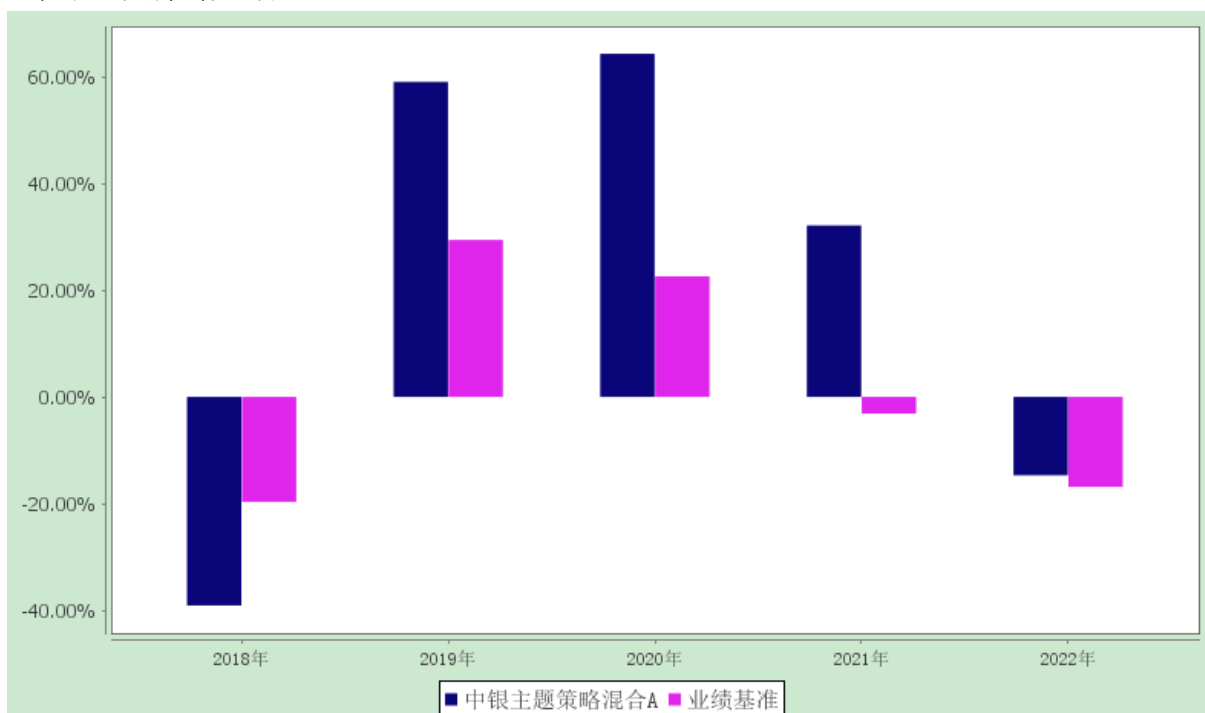
注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年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

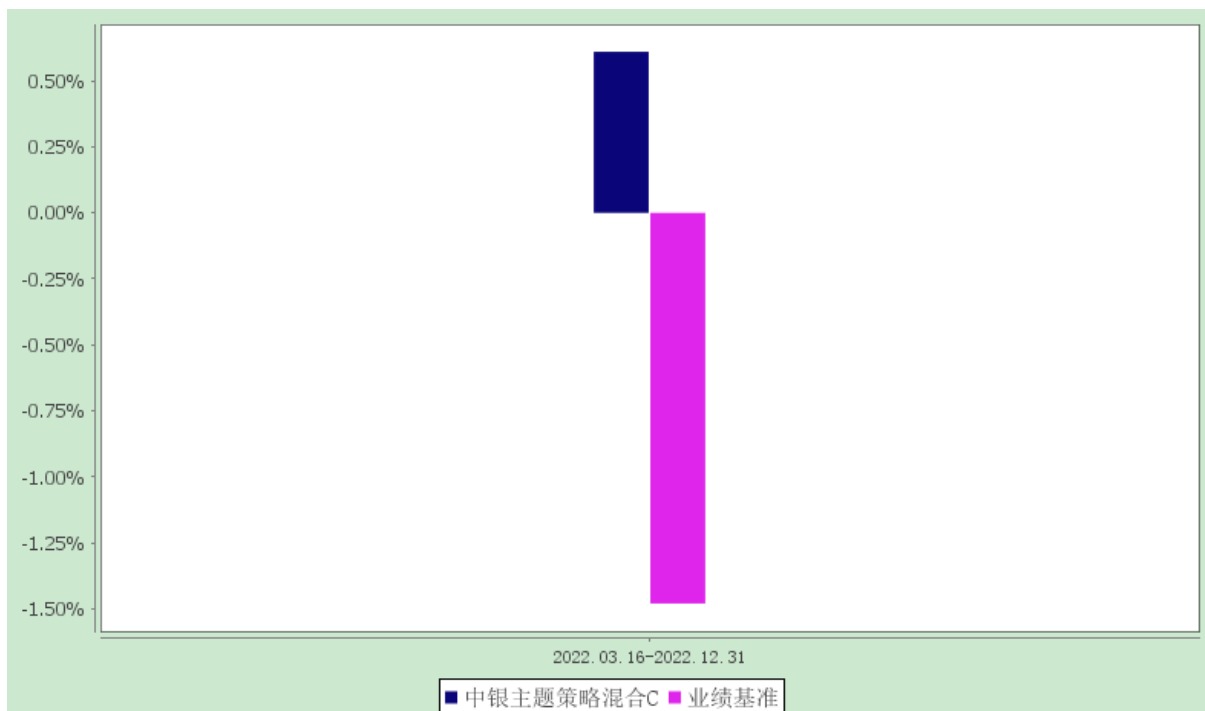
中银主题策略混合型证券投资基金

过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、中银主题策略混合 A



2、中银主题策略混合 C



注：本基金自 2022 年 3 月 16 日起增设 C 类基金份额，截至报告期末新增份额生效未满五年。合同/新增份额生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，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

1、中银主题策略混合 A：

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

2、中银主题策略混合 C：

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注

2022 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为中银基金管理有限公司，由中国银行股份有限公司和贝莱德投资管理有限公司两大全球著名领先金融品牌强强联合组建的中外合资基金管理公司，致力于长期参与中国基金业的发展，努力成为国内领先的基金管理公司。

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金等一百多余只开放式证券投资基金，同时管理着多个私募资产管理计划。

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		
黄珺	基金经理	2019-03-13	-	14	中银基金管理有限公司高级副总裁（SVP），管理学硕士。曾任平安资管投资经理。2018 年加入中银基金管理有限公司，2019 年 3 月至今任中银主题基金基金经理，2020 年 2 月至今任中银收益基金基金经理，2021 年 9 月至今任中银鑫新消费成长基金基金经理，2021 年 11 月至今任中银大健康基金基金经理。具备基金从业资格。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《中银基金管理有限公司公平交易管理办法》，建立了《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生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。

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

1.宏观经济分析

国外经济方面,2022 年美国宏观经济主线上半年仍为抗通胀,自三季度通胀出现明显下行趋势后,衰退成为新的宏观主题。具体看,美国四个季度 GDP 环比折年率分别为-1.6%,-0.6%,3.2%,2.9%,GDP 不变价同比分别录得 3.68%,1.8%,1.94%,0.96%,美国消费增长结构总体从商品消费为主转为服务消费为主,生产端的修复总体不明显。全年 CPI 呈现高位倒 U 型走势,CPI 自 1 月 7.5%上行至 6 月最高点 9.1%,随后震荡回落至 12 月的 6.5%左右,全年 CPI 同比涨 8%。美国就业市场维持偏紧状态,失业率从 1 月的 4.0%逐步回落至 12 月的 3.5%。在通胀持续超预期的背景下,美联储 2022 年持续加息,截止 12 月末,联邦基金目标利率达到了 4.5%。欧元区在受到俄乌冲突影响更大的背景下,滞胀风险高于美国,欧元区通胀在 2 月俄乌事件情况恶化后受能源价格上涨影响快速抬升,HICP 通胀率从 1 月的 5.1%持续上行至年内高点的 10 月同比 10.6%,随后缓慢回落至 12 月的 9.2%。高通胀与低复苏动能双重影响下,欧元区经济增长也趋于疲软,前三季度 GDP 不变价同比分别为 5.6%,4.3%,2.4%。日本前三季度 GDP 实际增速分别录得 0.4%,1.6%,1.5%,时隔多年日本通胀出现明显回升,CPI 通胀同比增速从 1 月的 0.5%上行至 12 月的 4%。日央行鸽派态度在 2022 年并未发生明显变化,需关注 2023 年 BOJ 新任行长可能带来的调整。

2022 年国内经济增长压力相对较大,受二季度华东疫情扰动和四季度疫情防控政策先紧后松的影响全年呈现波浪形走势,四个季度实际 GDP 增速分别录得 4.8%,0.4%,3.9%,2.9%,全年经济实际增速 3%左右。分部门来看,投资全年依靠基建托底,地产投资直至 11 月全年呈加速下行态势,最低为 11 月录得-19.7%,基建投资自 6 月起持续保持 10%以上较高速增长,全年固定投资累计增速录得 5.1%;规模以上工业增加值全年增长 3.6%,相较于其他指标而言全年波动较小;消费为 2022 年另一大对经济增长施压的项目,全年录得负增长-0.25%,二、四季度在居民实际收入和收入信心下行的影响下,消费增速均为负。对外贸易方面,全年进口在内需疲弱背景下持续位于低位,出口在外需放缓背景下自三季度起快速下行,出口同比从 9 月的 5.6%快速下行至 12 月的-9.9%。通胀方面,PPI 全年呈回落态势并于四季度转负,全年均值 4.2%,CPI 全年在消费需求疲软,猪周期影响逐步消退带动下也较为温和,全年均值 2.0%。基于温和通胀与较疲弱的经济基本面,全年货币政策维持较为宽松状态,全年 M0 平均同比达 13.2%,远高于 2021 年的 5.05%,也高于 2020 年的 9.82%。但社融和信贷增长仍较为疲弱,2022 年全年新增贷款 21.31 万亿元,较 2021 年多增 1.36 万亿元,2022 年疫情持续影响经济背景下,政策持续推动信贷投放,使得全年信贷增长有所加快;全年居民贷款增加 3.83 万亿元,较 2021 年少增 4.09 万亿元,由于消费和购房支出大幅减少,全年居民贷款需求大幅下降;全年企业贷款增加 17.09 万亿元,较 2021 年多增 5.07 万亿元,疫情冲击背景下政策着力稳增长,推动对企业信贷投放明显增加。2022 年全年社会融资增量 32.01 万亿元,较 2021 年多增 6689 亿元,全年社融增速从 2021 年的 10.3%降至 9.6%,融资需求低迷背景下,社融增长持续乏力。

2.市场回顾

2022 年股市整体以震荡下跌为主，四个季度之间行业轮动较为明显，全年历经了多个黑天鹅事件，包括美联储通胀超预期导致的持续加息，俄乌战争，国内疫情的超预期使得全年总体上市场表现较差，但其中不乏阶段性投资机会。其中一季度市场稳增长板块有超额收益，市场预期在全年 GDP 增速要达到目标的情况下对于基建地产类公司有相对收益，但一季度表现最为亮眼的是煤炭板块，也是受益于俄乌冲突导致的能源价格上涨。二季度，新能源行业在 4 月份大幅下跌后 5 月份开始困境反转，尤其是以光伏逆变器为代表的公司表现出色，进入三季度，市场在反弹后高位震荡逐渐下跌，尤其是到 10 月份，市场情绪达到低点，四季度在 11 月份后市场 V 型反转，在国内最重要的疫情防控政策和地产政策上都边际向好，具体到行业上计算机、医药与食品饮料表现较好。

债券收益率整体在 2.55%-2.95% 区间震荡，债券指数涨跌不一，全年中债总全价指数上涨 0.19%，中债银行间国债全价指数上涨 0.47%，中债企业债总全价指数下跌 1.44%。货币市场方面，流动性总体充裕，资金利率在低位波动，银行间 1 天回购加权平均利率均值在 1.54%，较上年均值下行 49bp，7 天回购加权平均利率均值在 1.95%，较上年均值下行 38bp。

3. 运行分析

2022 年股票市场总体下行，债券市场各品种涨跌互现，本基金业绩表现好于比较基准。策略上，我们保持相对稳定的高仓位，积极参与市场的结构性投资机会，优化配置结构，重点配置了美容护理、食品饮料、交通运输、医药、传媒和机器人相关行业中的优质上市公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-14.69%，同期业绩比较基准收益率为-16.86%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 0.61%，同期业绩比较基准收益率为-1.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，全球经济进入下行周期，美联储加息放缓，市场关注点逐步转为美国经济能否“软着陆”。海外方面，2023 年全球经济进入下行周期，美国经济随着加息进程推进而放缓，欧洲经济不确定性仍然较高。海外通胀预计总体回落，但仍有一定粘性。政策方面，预计全球主要经济体央行将依次放缓加息步伐，但仍会将利率维持在限制性水平，在不出现经济或金融危机引发深度衰退的情况下降息幅度相对有限。

从国内来看，2023 年宏观经济有望在稳增长政策推动下逐步修复，制造业和新基建预计将是本轮政策重点支持方向，消费总量恢复，疤痕效应制约超额储蓄释放，地产合理需求依然存在，地产投资逐步企稳；物价水平整体温和，通胀上行风险较小。根据中央经济工作会议的定调，扩大内需是 2023 年中国经济和政策的主线，预计财政政策唱

主角，货币政策做好流动性配合。财政政策方面，“加力提效”主要依赖中央加杠杆，政策性金融工具承担更重要责任；货币政策力度稳中有扩，但更强调精准，全面降准降息空间有限，结构性工具愈加重要。

权益方面，我们认为 2023 年 A 股市场有望震荡上行。目前 A 股处于中长期底部区域，慢牛逻辑未变；流动性方面，国内货币政策将保持宽松，信贷增速上行有望提振市场估值，海外美联储紧缩逐渐退坡，美债收益率有望下行；风险偏好方面，中央经济工作会议释放清晰的稳增长与提振市场信心信号，政策环境偏暖对市场构成支撑。微观资金面上，伴随着市场转暖，居民超额储蓄释放，私募、险资、外资都有望流入增量资金。另外地缘政治紧张趋势也有望总体趋稳。在市场风格上，相较于价值类公司，我们更看好成长型公司的投资机会，包括消费成长和科技制造成长类。消费成长类的公司包括了新兴消费与困境反转类的泛消费类公司，尤其是传媒与航空行业。科技制造成长类，我们看好机器人相关方向，尤其是偏硬件制造的相关公司，期待未来行业从量变到质变的飞跃。

信用债方面，理财赎回潮冲击后，中短久期中高等级信用债的估值回到历史较高水平，具有票息价值；信用分层仍会持续，低等级和弱区域风险需防范，区域流动性分化、理财净值化转型中资产配置行为的变化仍是未来风险因素。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人坚持一切从防范风险、保护基金份额持有人利益出发，致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司内控部门与审计部按照制度，通过基金运作监控和内部审计等方法，独立地开展工作，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改。

本报告期内，本基金的监察稽核主要工作情况如下：

（1）深入开展审计检查，确保基金运作合规性

主要措施有：对基金运作涉及的投资、研究、交易、风险管理、信息资讯等业务环节开展独立检查，及时发现业务流程中存在的风险并督促整改，确保相关业务运作符合法律法规及公司制度的规定。

（2）修订内部管理制度，完善投资业务流程

根据监管机关的规定，定期更新公司内部投资管理制度，不断加强内部流程控制，动态作出各项合规提示，防范投资风险。

通过以上工作的开展，在本报告期内，本基金运作过程中未发生违规关联交易、内幕交易，基金运作整体合法合规。本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高合规与审计工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金份额持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由基金运营、风险管理、研究及相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。估值委员会审议并依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场环境相适应的估值方法，基金运营部应征询会计师事务所、基金托管人的相关意见。当改变估值技术时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，会计师事务所应对基金管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表审核意见，同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。另外，对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的，应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见，并经估值委员会审议，采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

4.7.2 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.7.3 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的 20%。

本报告期期末 A 类基金份额可供分配利润为 705,783,011.30 元，C 类基金份额可供分配利润为 195,719,085.73 元。本基金本报告期末未进行利润分配。

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

本基金在报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中银主题策略混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

安永华明（2023）审字第 61062100_B16 号

中银主题策略混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了中银主题策略混合型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的中银主题策略混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中银主题策略混合型证券投资基金 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的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中银主题策略混合型证券投资基金，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

中银主题策略混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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

管理层负责按照企业会计准则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，管理层负责评估中银主题策略混合型证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督中银主题策略混合型证券投资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，就可能导致对中银主题策略混合型证券投资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中银主题策略混合型证券投资基金不能持续经营。

(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。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

陈露 徐雯

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

2023 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中银主题策略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	297,793,469.73	25,593,489.30
结算备付金		5,977,428.95	2,039,125.46
存出保证金		1,734,308.44	326,430.95
交易性金融资产	7.4.7.2	2,056,896,491.07	720,147,425.32
其中：股票投资		1,945,023,700.07	682,331,107.22
基金投资		-	-
债券投资		111,872,791.00	37,816,318.10
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		40,407,218.64	82,867.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	530,167.26
资产总计		2,402,808,916.83	748,719,505.45
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		167,036,392.61	4,736,069.94
应付赎回款		74,915.83	113,095.77
应付管理人报酬		2,125,039.78	798,110.24
应付托管费		354,173.30	133,018.35
应付销售服务费		124,772.72	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4.51	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	4,219,396.44	1,160,258.43
负债合计		173,934,695.19	6,940,552.73
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	588,909,220.01	167,106,375.92
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	1,639,965,001.63	574,672,576.80
净资产合计		2,228,874,221.64	741,778,952.72
负债和净资产总计		2,402,808,916.83	748,719,505.45

注：1.报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 588,909,220.01 份，其中 A 类基金份额净值 3.787 元，基金份额 460,313,770.39 份；C 类基金份额净值 3.775 元，基金份额 128,595,449.62 份。

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

7.2 利润表

会计主体：中银主题策略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 1 月 1 日 至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-187,721,722.01	112,319,921.94
1.利息收入		623,009.50	671,266.21
其中：存款利息收入	7.4.7.9	623,009.50	186,298.32
债券利息收入		-	484,967.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-196,348,365.62	126,265,887.51
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-202,700,843.35	124,629,552.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,540,148.08	134,840.91
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	4,812,329.65	1,501,494.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	7,335,752.28	-14,908,871.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	667,881.83	291,639.54
减：二、营业总支出		21,602,829.66	12,390,954.41
1. 管理人报酬	7.4.10.2	17,688,032.91	5,957,124.93
2. 托管费	7.4.10.2	2,948,005.51	992,854.16
3. 销售服务费		805,922.71	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		3.26	2.71
8. 其他费用	7.4.7.17	160,865.27	5,440,972.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-209,324,551.67	99,928,967.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-209,324,551.67	99,928,967.53

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-209,324,551.67	99,928,967.53

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

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中银主题策略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（基金净值）	167,106,375.92	574,672,576.80	741,778,952.72
二、本期期初净资产（基金净值）	167,106,375.92	574,672,576.80	741,778,952.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	421,802,844.09	1,065,292,424.83	1,487,095,268.92
（一）、综合收益总额	-	-209,324,551.67	-209,324,551.67
（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）	421,802,844.09	1,274,616,976.50	1,696,419,820.59
其中：1.基金申购款	582,759,809.52	1,739,715,188.35	2,322,474,997.87
2.基金赎回款	-160,956,965.43	-465,098,211.85	-626,055,177.28
（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)	588,909,220.01	1,639,965,001.63	2,228,874,221.64
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	112,441,851.03	265,239,678.20	377,681,529.23
二、本期期初净资产(基金净值)	112,441,851.03	265,239,678.20	377,681,529.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	54,664,524.89	309,432,898.60	364,097,423.49
(一)、综合收益总额	-	99,928,967.53	99,928,967.53
(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)	54,664,524.89	209,503,931.07	264,168,455.96
其中：1.基金申购款	135,523,979.54	433,759,583.53	569,283,563.07
2.基金赎回款	-80,859,454.65	-224,255,652.46	-305,115,107.11
(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)	167,106,375.92	574,672,576.80	741,778,952.72

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: 张家文, 主管会计工作负责人: 陈宇, 会计机构负责人: 乐妮

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中银主题策略混合型证券投资基金(以下简称“本基金”), 原中银主题策略股票型证券投资基金, 系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[2012]805号文《关于核准中银主题策略股票型证券投资基金募集的批复》的核准, 由基金管理人

中银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2012 年 7 月 25 日正式生效，首次设立募集规模为 895,045,013.12 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为广发银行股份有限公司。

根据中国证券监督管理委员会于 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，中银基金管理有限公司决定自 2015 年 8 月 7 日起将本基金变更为混合基金，并相应修改本基金的《基金合同》。

根据相关法律法规、基金合同和招募说明书约定，经与本基金的基金托管人广发银行股份有限公司协商一致，本基金自 2022 年 3 月 16 日起增加 C 类基金份额，并相应修改《中银主题策略混合型证券投资基金基金合同》及《中银主题策略混合型证券投资基金托管协议》。

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（含中小板、创业板）、存托凭证、债券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）。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于 2023 年 3 月 29 日批准。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时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、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

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

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

收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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

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

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言

具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

本基金持有的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，按照估值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作为公允价值；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，应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，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务

的期间计入当期损益。

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

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

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

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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) 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) 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

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《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）。新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：以摊余成本计量的金融资产：银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币25,593,489.30元，自应收利息转入的重分类金额为人民币6,812.09元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币25,600,301.39元。结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币2,039,125.46元，自应收利息转入的重分类金额为人民币917.60元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币2,040,043.06元。存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币326,430.95元，自应收利息转入的重分类金额为人民币146.90元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币326,577.85元。应收申购款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币82,867.16元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1,153.27元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币84,020.43元。应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币530,167.26元，转出至银行存款的重分类金额为人民币6,812.09元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币917.60元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币146.90元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币521,137.40元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币1,153.27元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：交易性金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人

人民币 720,147,425.32 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 521,137.40 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 720,668,562.72 元。除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券

投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	297,793,469.73	25,593,489.30
等于：本金	297,765,184.00	25,593,489.30
加：应计利息	28,285.73	-
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	297,793,469.73	25,593,489.30

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		1,892,162,406.01	-	1,945,023,700.07	52,861,294.06
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	110,464,529.30	1,643,160.30	111,872,791.00	-234,898.60
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	110,464,529.30	1,643,160.30	111,872,791.00	-234,898.60
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,002,626,935.31	1,643,160.30	2,056,896,491.07	52,626,395.46
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		637,013,715.74	-	682,331,107.22	45,317,391.48
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	37,843,066.40	-	37,816,318.10	-26,748.30
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	37,843,066.40	-	37,816,318.10	-26,748.30
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		674,856,782.14	-	720,147,425.32	45,290,643.18

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

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未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	530,167.26
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	530,167.26

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	136.61	160.30
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	4,059,259.83	1,000,098.13
其中：交易所市场	4,059,259.83	1,000,098.13
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付审计费	40,000.00	40,000.00
合计	4,219,396.44	1,160,258.43

7.4.7.7 实收基金

中银主题策略混合 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（份）	账面金额
上年度末	167,106,375.92	167,106,375.92
本期申购	366,848,923.33	366,848,923.33
本期赎回（以“-”号填列）	-73,641,528.86	-73,641,528.86
本期末	460,313,770.39	460,313,770.39

中银主题策略混合 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（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	215,910,886.19	215,910,886.19
本期赎回（以“-”号填列）	-87,315,436.57	-87,315,436.57
本期末	128,595,449.62	128,595,449.62

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

中银主题策略混合 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	377,351,916.71	197,320,660.09	574,672,576.80
本期利润	-185,351,967.84	18,146,607.81	-167,205,360.03
本期基金份额交易产生的变动数	513,783,062.43	361,798,592.85	875,581,655.28
其中：基金申购款	646,013,710.03	442,409,121.07	1,088,422,831.10
基金赎回款	-132,230,647.60	-80,610,528.22	-212,841,175.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	705,783,011.30	577,265,860.75	1,283,048,872.05

中银主题策略混合 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
上年度末	-	-	-
本期利润	-31,308,336.11	-10,810,855.53	-42,119,191.64
本期基金份额交易产生的变动数	227,027,421.84	172,007,899.38	399,035,321.22
其中：基金申购款	377,616,206.55	273,676,150.70	651,292,357.25
基金赎回款	-150,588,784.71	-101,668,251.32	-252,257,036.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	195,719,085.73	161,197,043.85	356,916,129.58

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
活期存款利息收入	532,146.59	152,251.76
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	62,406.96	20,160.23
其他	28,455.95	13,886.33
合计	623,009.50	186,298.32

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
卖出股票成交总额	4,785,580,709.62	1,662,215,143.71
减：卖出股票成本总额	4,972,366,834.91	1,537,585,591.26
减：交易费用	15,914,718.06	-
买卖股票差价收入	-202,700,843.35	124,629,552.45

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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年 12月31日	2021年1月1日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	1,247,133.86	-
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	293,014.22	134,840.91
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	1,540,148.08	134,840.91

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1月1日至2021年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	49,666,702.29	38,440,665.86
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	48,374,676.52	37,551,440.37
减：应计利息总额	998,889.64	754,384.58
减：交易费用	121.91	-
买卖债券差价收入	293,014.22	134,840.91

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

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 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。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	4,812,329.65	1,501,494.15
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	4,812,329.65	1,501,494.15

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
1.交易性金融资产	7,335,752.28	-14,908,871.32
——股票投资	7,543,902.58	-14,991,644.14
——债券投资	-208,150.30	82,772.82
——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	7,335,752.28	-14,908,871.32

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
基金赎回费收入	666,272.15	288,290.50
基金转换费收入	1,609.68	3,349.04
合计	667,881.83	291,639.54

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
交易费用	-	5,280,972.61
其他	865.27	-
合计	160,865.27	5,440,972.61

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
中银基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
广发银行股份有限公司（“广发银行”）	基金托管人、基金销售机构
贝莱德投资管理（英国）有限公司	基金管理人的股东
中银资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国银行股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构

中银国际证券股份有限公司	受中国银行重大影响、基金销售机构
中银（新加坡）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：以下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

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交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	17,688,032.91	5,957,124.93
其中：支付销售机构的客户维护费	1,659,743.91	1,007,190.13

注：基金管理费每日计提，按月支付。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：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,948,005.51	992,854.16

注：基金托管费每日计提，按月支付。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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银主题策略混合A	中银主题策略混合C	合计
中银基金管理有限公司	-	373,343.42	373,343.42
合计	-	373,343.42	373,343.42
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银主题策略混合A	中银主题策略混合C	合计
中银基金管理有限公司	-	-	-
合计	-	-	-

注：1.本基金自 2022 年 3 月 16 日起增加 C 类基金份额；

2.A 类基金份额不收取销售服务费。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，按月支付给中银基金管理有限公司，再由中银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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	中银主题策略混合 A	中银主题策略混合 C	中银主题策略混合 A	中银主题策略混合 C
报告期初持有的基金份额	-	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	7,406,141.86	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	7,406,141.86	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.61%	-	-	-

注：（1）期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

（2）本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发银行股份有限公司	297,793,469.73	532,146.59	25,593,489.30	152,251.76

注：本基金的银行存款由基金托管人广发银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
中银国际证券股份有限公司	600938	中国海油	公开发行	120,005	1,296,054.00
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本	期末估值	备注

				限类 型				总额	总额	
68804 1	海光 信息	2022- 08-05	6 个 月	新股 锁定 期内	36.00	39.15	23,95 3	862,3 08.00	937,7 59.95	-
68837 5	国博 电子	2022- 07-13	6 个 月	新股 锁定 期内	70.88	94.20	6,110	433,0 76.80	575,5 62.00	-
68850 6	百利 天恒	2022- 12-28	1 个 月内 (含)	新股 未上 市	24.70	24.70	15,62 2	385,8 63.40	385,8 63.40	-
68829 3	奥浦 迈	2022- 08-26	6 个 月	新股 锁定 期内	80.20	99.12	2,452	196,6 50.40	243,0 42.24	-
68808 4	晶品 特装	2022- 12-01	6 个 月	新股 锁定 期内	60.98	74.73	1,875	114,3 37.50	140,1 18.75	-
68842 6	康为 世纪	2022- 10-18	6 个 月	新股 锁定 期内	48.98	33.12	3,776	184,9 48.48	125,0 61.12	-
30126 9	华大 九天	2022- 07-21	6 个 月	新股 锁定 期内	32.69	87.94	1,084	35,43 5.96	95,32 6.96	-
30126 7	华夏 眼科	2022- 10-26	6 个 月	新股 锁定 期内	50.88	66.20	1,006	51,18 5.28	66,59 7.20	-
30132 7	华宝 新能	2022- 09-08	6 个 月	新股 锁定 期内	237.5 0	176.9 7	242	57,47 5.00	42,82 6.74	-
30123 9	普瑞 眼科	2022- 06-22	6 个 月	新股 锁定 期内	33.65	69.68	575	19,34 8.75	40,06 6.00	-
30136 7	怡和 嘉业	2022- 10-21	6 个 月	新股 锁定 期内	119.8 8	175.7 8	223	26,73 3.24	39,19 8.94	-
30117 5	中科 环保	2022- 06-30	6 个 月	新股 锁定 期内	3.82	6.01	6,370	24,33 3.40	38,28 3.70	-
30130 1	川宁 生物	2022- 12-20	6 个 月	新股 锁定 期内	5.00	7.53	3,574	17,87 0.00	26,91 2.22	-
30115 2	天力 锂能	2022- 08-19	6 个 月	新股 锁定	57.00	46.64	433	24,68 1.00	20,19 5.12	-

				期内						
301349	信德新材	2022-08-30	6个月	新股锁定期内	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60	-
301171	易点天下	2022-08-10	6个月	新股锁定期内	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301363	美好医疗	2022-09-28	6个月	新股锁定期内	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301296	新巨丰	2022-08-26	6个月	新股锁定期内	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-
301328	维峰电子	2022-08-30	6个月	新股锁定期内	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301121	紫建电子	2022-08-01	6个月	新股锁定期内	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301377	鼎泰高科	2022-11-11	6个月	新股锁定期内	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301311	昆船智能	2022-11-23	6个月	新股锁定期内	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-
301297	富乐德	2022-12-23	6个月	新股锁定期内	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-
301338	凯格精机	2022-08-08	6个月	新股锁定期内	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301283	聚胶股份	2022-08-26	6个月	新股锁定期内	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301132	满坤科技	2022-08-03	6个月	新股锁定期内	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301277	新天地	2022-11-09	6个月	新股锁定期内	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301379	天山电子	2022-10-19	6个月	新股锁定期内	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87	-
30128	金禄	2022-	6个	新股	30.38	25.25	434	13,18	10,95	-

2	电子	08-18	月	锁定期内				4.92	8.50	
301306	西测测试	2022-07-19	6个月	新股锁定期内	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301265	华新环保	2022-12-08	6个月	新股锁定期内	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301176	逸豪新材	2022-09-21	6个月	新股锁定期内	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301318	维海德	2022-08-03	6个月	新股锁定期内	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-
301227	森鹰窗业	2022-09-16	6个月	新股锁定期内	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301326	捷邦科技	2022-09-09	6个月	新股锁定期内	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-
301197	工大科雅	2022-07-29	6个月	新股锁定期内	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301161	唯万密封	2022-09-06	6个月	新股锁定期内	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6个月	新股锁定期内	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301285	鸿日达	2022-09-21	6个月	新股锁定期内	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6个月	新股锁定期内	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301388	欣灵电气	2022-10-26	6个月	新股锁定期内	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301368	丰立智能	2022-12-07	6个月	新股锁定期内	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301300	远翔新材	2022-08-09	6个月	新股锁定期内	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-

301319	唯特偶	2022-09-22	6个月	新股锁定期内	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301270	汉仪股份	2022-08-19	6个月	新股锁定期内	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301231	荣信文化	2022-08-31	6个月	新股锁定期内	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301309	万得凯	2022-09-08	6个月	新股锁定期内	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月	新股锁定期内	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301316	慧博云通	2022-09-29	6个月	新股锁定期内	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600038	中直股份	2022-12-26	重大资产重组	46.41	2023-01-10	51.05	80,100	3,777,901.00	3,717,441.00	-

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，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

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，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险管理与内部控制委员会、督察长、风险管理部、内控与法律合规部、审计部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理与内部控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法

在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金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公司的证券不得超过该证券的 10%。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，因此除附注“期末本基金持有的流通受限证券”列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年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	297,793,469.73	-	-	-	297,793,469.73
结算备付金	5,977,428.95	-	-	-	5,977,428.95
存出保证金	1,734,308.44	-	-	-	1,734,308.44
交易性金融资产	111,872,791.00	-	-	1,945,023,700.07	2,056,896,491.07
应收申购款	35,006,101.34	-	-	5,401,117.30	40,407,218.64
资产总计	452,384,099.46	-	-	1,950,424,817.37	2,402,808,916.83
负债					
应付证券清算款	-	-	-	167,036,392.61	167,036,392.61
应付赎回款	-	-	-	74,915.83	74,915.83
应付管理人报酬	-	-	-	2,125,039.78	2,125,039.78
应付托管费	-	-	-	354,173.30	354,173.30
应付销售服务费	-	-	-	124,772.72	124,772.72
应交税费	-	-	-	4.51	4.51
其他负债	-	-	-	4,219,396.44	4,219,396.44
负债总计	-	-	-	173,934,695.19	173,934,695.19
利率敏感度缺口	452,384,099.46	-	-	-1,776,490,122.18	2,228,874,221.64
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	25,593,489.30	-	-	-	25,593,489.30
结算备付金	2,039,125.46	-	-	-	2,039,125.46
存出保证金	326,430.95	-	-	-	326,430.95
交易性金融资产	37,816,318.10	-	-	682,331,107.22	720,147,425.32

应收利息	-	-	-	530,167.26	530,167.26
应收申购款	3,303.70	-	-	79,563.46	82,867.16
资产总计	65,778,667.51	-	-	682,940,837.94	748,719,505.45
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,736,069.94	4,736,069.94
应付赎回款	-	-	-	113,095.77	113,095.77
应付管理人报酬	-	-	-	798,110.24	798,110.24
应付托管费	-	-	-	133,018.35	133,018.35
应付交易费用	-	-	-	1,000,098.13	1,000,098.13
其他负债	-	-	-	160,160.30	160,160.30
负债总计	-	-	-	6,940,552.73	6,940,552.73
利率敏感度缺口	65,778,667.51	-	-	676,000,285.21	741,778,952.72

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

本报告期末，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金净资产的比例低于10%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,945,023,700.07	87.26	682,331,107.22	91.99
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	1,945,023,700.07	87.26	682,331,107.22	91.99

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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：人民币万元）	
		本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 11,948	增加约 4,164
2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 11,948	减少约 4,164	

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	本期末	上年度末
-------------	-----	------

层次	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,938,178,954.18	680,696,680.48
第二层次	115,976,095.40	38,045,450.05
第三层次	2,741,441.49	1,405,294.79
合计	2,056,896,491.07	720,147,425.32

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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,405,294.79	1,405,294.79
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,442,993.00	2,442,993.00
转出第三层次	-	1,210,366.84	1,210,366.84
当期利得或损失总额	-	103,520.54	103,520.54
其中：计入损益的利得或损失	-	103,520.54	103,520.54
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末	-	2,741,441.49	2,741,441.49

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	-	298,448.49	298,448.49
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	819,284.60	819,284.60
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	586,010.19	586,010.19
其中：计入损益的利得或损失	-	586,010.19	586,010.19
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	1,405,294.79	1,405,294.79
期末仍持有的第三层次金融资产	-	586,010.19	586,010.19

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			
------------------------------	--	--	--

7.4.14.2.3.2 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
股票投资	2,741,441.49	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.2063-2.4756	预期年化波动率越高，公允价值越低
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
股票投资	1,405,294.79	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.3138-2.7417	预期年化波动率越高，公允价值越低

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.15.2 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。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2023 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	1,945,023,700.07	80.95
	其中：股票	1,945,023,700.07	80.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	111,872,791.00	4.66
	其中：债券	111,872,791.00	4.66
	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	303,770,898.68	12.64
8	其他各项资产	42,141,527.08	1.75
9	合计	2,402,808,916.83	100.00

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票，本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

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	6,130,288.00	0.28
C	制造业	1,154,513,544.41	51.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,302,326.00	0.60
E	建筑业	3,822,285.00	0.17

F	批发和零售业	11,888,526.00	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	341,435,006.13	15.32
H	住宿和餐饮业	27,330,773.40	1.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,740,539.96	1.87
J	金融业	23,095,800.00	1.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	101,310,765.08	4.55
M	科学研究和技术服务业	6,747,011.04	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	38,283.70	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,184,692.00	0.37
Q	卫生和社会工作	101,732,668.55	4.56
R	文化、体育和娱乐业	103,751,190.80	4.65
S	综合	-	-
	合计	1,945,023,700.07	87.26

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300896	爱美客	221,150	125,248,302.50	5.62
2	688363	华熙生物	663,958	89,820,238.24	4.03
3	601111	中国国航	8,180,000	86,708,000.00	3.89
4	600233	圆通速递	3,365,429	67,611,468.61	3.03
5	600029	南方航空	8,843,800	67,212,880.00	3.02
6	600298	安琪酵母	1,459,859	66,014,823.98	2.96
7	000858	五粮液	325,500	58,814,595.00	2.64
8	002568	百润股份	1,378,808	51,512,266.88	2.31
9	002050	三花智控	2,216,000	47,023,520.00	2.11
10	002698	博实股份	3,355,300	47,007,753.00	2.11
11	002352	顺丰控股	712,600	41,159,776.00	1.85
12	600138	中青旅	2,636,832	40,053,478.08	1.80

13	002027	分众传媒	5,993,400	40,035,912.00	1.80
14	600763	通策医疗	253,500	38,782,965.00	1.74
15	603728	鸣志电器	1,119,300	37,306,269.00	1.67
16	002020	京新药业	2,990,600	36,425,508.00	1.63
17	000516	国际医学	2,896,900	35,458,056.00	1.59
18	002852	道道全	2,522,535	34,911,884.40	1.57
19	600519	贵州茅台	20,000	34,540,000.00	1.55
20	300413	芒果超媒	1,093,515	32,827,320.30	1.47
21	300119	瑞普生物	1,422,230	26,467,700.30	1.19
22	601021	春秋航空	394,600	25,353,050.00	1.14
23	600522	中天科技	1,273,400	20,565,410.00	0.92
24	300351	永贵电器	1,322,773	20,463,298.31	0.92
25	603885	吉祥航空	1,223,700	19,799,466.00	0.89
26	300763	锦浪科技	109,642	19,741,042.10	0.89
27	300251	光线传媒	2,213,900	19,172,374.00	0.86
28	300957	贝泰妮	126,591	18,892,440.84	0.85
29	601007	金陵饭店	1,517,370	18,693,998.40	0.84
30	002739	万达电影	1,325,735	18,560,290.00	0.83
31	603043	广州酒家	696,280	17,977,949.60	0.81
32	002928	华夏航空	1,281,700	17,725,911.00	0.80
33	000568	泸州老窖	78,100	17,516,268.00	0.79
34	300633	开立医疗	311,200	17,063,096.00	0.77
35	601318	中国平安	361,800	17,004,600.00	0.76
36	301267	华夏眼科	229,691	16,785,757.55	0.75
37	301102	兆讯传媒	444,300	16,328,025.00	0.73
38	300360	炬华科技	1,070,538	15,576,327.90	0.70
39	600977	中国电影	1,072,300	14,583,280.00	0.65
40	300910	瑞丰新材	118,000	14,550,580.00	0.65
41	688111	金山办公	53,814	14,233,264.86	0.64
42	600487	亨通光电	897,000	13,508,820.00	0.61
43	002216	三全食品	726,969	13,456,196.19	0.60
44	300558	贝达药业	266,829	13,146,664.83	0.59
45	002385	大北农	1,454,400	12,944,160.00	0.58
46	000661	长春高新	74,748	12,441,804.60	0.56
47	601890	亚星锚链	1,306,361	11,535,167.63	0.52
48	688212	澳华内镜	160,803	10,530,988.47	0.47
49	002991	甘源食品	136,000	10,375,440.00	0.47
50	600435	北方导航	870,000	10,092,000.00	0.45
51	603309	维力医疗	501,900	10,027,962.00	0.45
52	002912	中新赛克	312,700	9,893,828.00	0.44
53	000799	酒鬼酒	70,300	9,697,182.00	0.44
54	000063	中兴通讯	361,223	9,341,226.78	0.42
55	600456	宝钛股份	226,600	9,258,876.00	0.42
56	600702	舍得酒业	58,000	9,232,440.00	0.41

57	600079	人福医药	384,100	9,176,149.00	0.41
58	688017	绿的谐波	91,350	8,840,853.00	0.40
59	688029	南微医学	107,558	8,833,738.54	0.40
60	600115	中国东航	1,581,684	8,746,712.52	0.39
61	603444	吉比特	27,600	8,634,384.00	0.39
62	601778	晶科科技	1,549,400	8,521,700.00	0.38
63	003032	传智教育	474,200	8,184,692.00	0.37
64	002338	奥普光电	355,700	7,928,553.00	0.36
65	688239	航宇科技	100,844	7,834,570.36	0.35
66	603103	横店影视	509,800	7,514,452.00	0.34
67	603520	司太立	371,700	7,274,169.00	0.33
68	600004	白云机场	474,200	7,117,742.00	0.32
69	301239	普瑞眼科	100,775	7,114,186.00	0.32
70	688166	博瑞医药	310,200	7,001,214.00	0.31
71	300133	华策影视	1,249,000	6,657,170.00	0.30
72	301011	华立科技	237,470	6,627,787.70	0.30
73	001215	千味央厨	100,600	6,595,336.00	0.30
74	000028	国药一致	197,400	6,492,486.00	0.29
75	603259	药明康德	80,000	6,480,000.00	0.29
76	603755	日辰股份	152,200	6,129,094.00	0.27
77	601336	新华保险	202,500	6,091,200.00	0.27
78	002389	航天彩虹	287,000	5,903,590.00	0.26
79	603687	大胜达	660,700	5,662,199.00	0.25
80	000951	中国重汽	364,900	5,415,116.00	0.24
81	605108	同庆楼	145,000	5,398,350.00	0.24
82	000963	华东医药	115,300	5,396,040.00	0.24
83	002695	煌上煌	356,300	4,945,444.00	0.22
84	605168	三人行	55,000	4,893,350.00	0.22
85	000591	太阳能	652,200	4,780,626.00	0.21
86	600779	水井坊	55,400	4,676,868.00	0.21
87	301286	侨源股份	189,200	4,675,132.00	0.21
88	600993	马应龙	204,760	4,627,576.00	0.21
89	600862	中航高科	204,400	4,556,076.00	0.20
90	300915	海融科技	106,600	4,455,880.00	0.20
91	688489	三未信安	43,944	4,452,845.52	0.20
92	301208	中亦科技	87,100	4,436,003.00	0.20
93	300788	中信出版	218,800	4,430,700.00	0.20
94	600129	太极集团	147,200	4,424,832.00	0.20
95	603232	格尔软件	287,797	4,374,514.40	0.20
96	603605	珀莱雅	26,000	4,354,480.00	0.20
97	603529	爱玛科技	93,200	4,275,084.00	0.19
98	603345	安井食品	24,700	3,998,436.00	0.18
99	603317	天味食品	139,200	3,825,216.00	0.17
100	002081	金螳螂	788,100	3,822,285.00	0.17

101	600038	中直股份	80,100	3,717,441.00	0.17
102	000807	云铝股份	334,300	3,717,416.00	0.17
103	603508	思维列控	222,484	3,633,163.72	0.16
104	002219	新里程	911,600	3,591,704.00	0.16
105	605589	圣泉集团	159,116	3,403,491.24	0.15
106	600984	建设机械	622,800	3,400,488.00	0.15
107	300856	科思股份	64,900	3,384,535.00	0.15
108	300782	卓胜微	29,300	3,348,990.00	0.15
109	600583	海油工程	543,200	3,291,792.00	0.15
110	600754	锦江酒店	55,500	3,238,425.00	0.15
111	688015	交控科技	133,577	3,205,848.00	0.14
112	600197	伊力特	127,200	3,121,488.00	0.14
113	601808	中海油服	171,200	2,838,496.00	0.13
114	688271	联影医疗	7,535	1,333,544.30	0.06
115	688041	海光信息	23,953	937,759.95	0.04
116	688375	国博电子	6,110	575,562.00	0.03
117	688506	百利天恒	15,622	385,863.40	0.02
118	688293	奥浦迈	2,452	243,042.24	0.01
119	688084	晶品特装	1,875	140,118.75	0.01
120	688426	康为世纪	3,776	125,061.12	0.01
121	301269	华大九天	1,084	95,326.96	0.00
122	301326	捷邦科技	2,264	87,002.05	0.00
123	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
124	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
125	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
126	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.00
127	301302	华如科技	466	29,837.98	0.00
128	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
129	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
130	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
131	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
132	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
133	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
134	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
135	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
136	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
137	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
138	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
139	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
140	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
141	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
142	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
143	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
144	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00

145	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
146	301087	可孚医疗	281	10,250.88	0.00
147	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
148	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
149	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
150	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
151	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
152	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
153	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
154	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
155	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
156	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
157	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
158	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
159	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
160	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
161	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
162	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
163	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
164	301316	慧博云通	359	5,140.88	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	300896	爱美客	137,591,883.10	18.55
2	601111	中国国航	97,639,062.62	13.16
3	002050	三花智控	94,746,049.69	12.77
4	688363	华熙生物	93,351,868.22	12.58
5	600298	安琪酵母	87,831,301.80	11.84
6	000661	长春高新	81,591,925.48	11.00
7	000858	五粮液	80,795,030.33	10.89
8	600522	中天科技	77,880,163.12	10.50
9	601137	博威合金	76,001,036.80	10.25
10	600029	南方航空	71,972,447.00	9.70
11	600519	贵州茅台	69,534,480.00	9.37
12	688408	中信博	67,665,481.79	9.12
13	002698	博实股份	66,409,264.40	8.95
14	002385	大北农	60,625,849.55	8.17
15	688029	南微医学	59,675,596.35	8.04
16	002056	横店东磁	58,262,804.15	7.85

17	000516	国际医学	58,183,927.14	7.84
18	300957	贝泰妮	57,608,163.11	7.77
19	603728	鸣志电器	56,649,005.72	7.64
20	300558	贝达药业	53,076,266.28	7.16
21	600487	亨通光电	51,298,278.18	6.92
22	002020	京新药业	51,133,737.42	6.89
23	002352	顺丰控股	51,128,437.06	6.89
24	002568	百润股份	49,824,591.63	6.72
25	300750	宁德时代	49,246,214.00	6.64
26	300119	瑞普生物	49,166,838.70	6.63
27	600597	光明乳业	48,901,029.98	6.59
28	600763	通策医疗	46,879,808.98	6.32
29	600138	中青旅	45,532,439.63	6.14
30	002852	道道全	42,767,542.55	5.77
31	600233	圆通速递	40,546,389.00	5.47
32	002129	中环股份	40,470,287.00	5.46
33	300413	芒果超媒	39,810,107.20	5.37
34	601007	金陵饭店	39,313,127.20	5.30
35	002142	宁波银行	36,899,948.51	4.97
36	603612	索通发展	36,879,921.60	4.97
37	300498	温氏股份	35,417,224.85	4.77
38	300217	东方电热	34,734,331.20	4.68
39	002027	分众传媒	34,010,362.29	4.58
40	300360	炬华科技	33,370,347.29	4.50
41	605111	新洁能	32,964,038.84	4.44
42	300351	永贵电器	32,166,521.20	4.34
43	688111	金山办公	31,435,363.99	4.24
44	603885	吉祥航空	30,929,116.92	4.17
45	300251	光线传媒	30,792,908.98	4.15
46	002979	雷赛智能	30,274,393.79	4.08
47	605108	同庆楼	29,601,493.30	3.99
48	300910	瑞丰新材	28,692,913.20	3.87
49	600438	通威股份	27,868,903.00	3.76
50	002338	奥普光电	27,366,002.01	3.69
51	002101	广东鸿图	27,166,917.36	3.66
52	603369	今世缘	26,499,382.80	3.57
53	600456	宝钛股份	26,479,346.16	3.57
54	603416	信捷电气	26,022,787.00	3.51
55	000333	美的集团	25,127,806.00	3.39
56	601128	常熟银行	24,922,251.71	3.36
57	603043	广州酒家	24,735,058.04	3.33
58	002192	融捷股份	24,600,948.00	3.32
59	300747	锐科激光	24,454,380.22	3.30
60	002100	天康生物	24,115,138.00	3.25

61	603668	天马科技	23,367,704.55	3.15
62	002120	韵达股份	23,216,545.00	3.13
63	603305	旭升集团	22,890,036.80	3.09
64	603737	三棵树	22,627,430.76	3.05
65	688017	绿的谐波	22,606,026.41	3.05
66	600004	白云机场	22,143,236.10	2.99
67	688187	时代电气	22,103,214.49	2.98
68	688033	天宜上佳	21,918,146.54	2.95
69	603529	爱玛科技	21,592,383.80	2.91
70	601318	中国平安	21,407,122.01	2.89
71	601615	明阳智能	21,293,475.44	2.87
72	300068	南都电源	20,778,990.53	2.80
73	689009	九号公司	20,670,984.55	2.79
74	002739	万达电影	20,527,512.65	2.77
75	000568	泸州老窖	20,524,300.22	2.77
76	002567	唐人神	20,238,484.00	2.73
77	601636	旗滨集团	20,202,058.00	2.72
78	601021	春秋航空	20,201,339.68	2.72
79	000651	格力电器	20,028,935.00	2.70
80	603444	吉比特	19,767,768.00	2.66
81	002928	华夏航空	19,526,388.32	2.63
82	002897	意华股份	19,192,378.34	2.59
83	001205	盛航股份	18,944,173.10	2.55
84	600111	北方稀土	18,898,245.00	2.55
85	300633	开立医疗	18,894,298.16	2.55
86	600079	人福医药	18,484,003.75	2.49
87	003029	吉大正元	18,021,509.00	2.43
88	300763	锦浪科技	17,999,927.14	2.43
89	688680	海优新材	17,982,565.45	2.42
90	600862	中航高科	17,847,197.00	2.41
91	300811	铂科新材	17,825,161.00	2.40
92	002422	科伦药业	17,666,678.74	2.38
93	601669	中国电建	17,482,953.00	2.36
94	002444	巨星科技	17,335,462.40	2.34
95	002216	三全食品	17,222,432.68	2.32
96	603595	东尼电子	17,170,665.60	2.31
97	003032	传智教育	16,729,083.00	2.26
98	300403	汉宇集团	16,585,279.80	2.24
99	300415	伊之密	16,577,131.00	2.23
100	002498	汉缆股份	16,492,298.48	2.22
101	601336	新华保险	16,479,286.75	2.22
102	000547	航天发展	16,388,983.52	2.21
103	002707	众信旅游	16,340,206.00	2.20
104	002891	中宠股份	16,302,960.96	2.20

105	601818	光大银行	16,300,547.00	2.20
106	601890	亚星锚链	16,147,053.47	2.18
107	688025	杰普特	16,138,177.42	2.18
108	603606	东方电缆	16,008,735.68	2.16
109	002840	华统股份	15,951,623.40	2.15
110	000001	平安银行	15,444,789.00	2.08
111	000762	西藏矿业	15,330,789.00	2.07
112	601985	中国核电	15,260,798.00	2.06
113	301102	兆讯传媒	15,159,663.07	2.04
114	000069	华侨城 A	15,068,735.00	2.03
115	600977	中国电影	14,885,758.34	2.01

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	601137	博威合金	82,612,954.32	11.14
2	002056	横店东磁	79,359,893.52	10.70
3	688408	中信博	61,538,234.92	8.30
4	000661	长春高新	60,082,180.62	8.10
5	300498	温氏股份	58,931,824.50	7.94
6	600597	光明乳业	51,544,367.61	6.95
7	600522	中天科技	51,132,275.52	6.89
8	688029	南微医学	47,971,062.69	6.47
9	300750	宁德时代	45,097,067.28	6.08
10	002385	大北农	45,080,930.18	6.08
11	600298	安琪酵母	43,699,514.60	5.89
12	605111	新洁能	43,612,826.98	5.88
13	002129	中环股份	43,597,969.70	5.88
14	300558	贝达药业	43,358,399.23	5.85
15	002897	意华股份	42,563,433.16	5.74
16	600519	贵州茅台	38,138,154.22	5.14
17	603612	索通发展	35,920,292.00	4.84
18	002120	韵达股份	35,171,553.79	4.74
19	002142	宁波银行	34,970,624.20	4.71
20	002101	广东鸿图	34,721,403.02	4.68
21	600487	亨通光电	34,448,879.00	4.64
22	000858	五粮液	34,077,877.00	4.59
23	300217	东方电热	33,051,396.00	4.46
24	300957	贝泰妮	31,730,640.67	4.28

25	002050	三花智控	30,894,597.00	4.16
26	603345	安井食品	30,485,683.16	4.11
27	603908	牧高笛	29,803,314.05	4.02
28	605108	同庆楼	29,779,399.90	4.01
29	605117	德业股份	29,598,728.00	3.99
30	601007	金陵饭店	27,895,646.50	3.76
31	002979	雷赛智能	27,148,668.68	3.66
32	000516	国际医学	26,802,625.06	3.61
33	603737	三棵树	26,398,062.95	3.56
34	603668	天马科技	26,328,478.08	3.55
35	600438	通威股份	25,285,153.00	3.41
36	601128	常熟银行	25,230,500.36	3.40
37	603369	今世缘	25,227,783.00	3.40
38	300896	爱美客	24,695,703.00	3.33
39	600233	圆通速递	24,119,862.40	3.25
40	300747	锐科激光	23,791,231.60	3.21
41	603043	广州酒家	22,799,823.00	3.07
42	002241	歌尔股份	22,660,394.00	3.05
43	000333	美的集团	22,604,571.10	3.05
44	603416	信捷电气	22,539,023.00	3.04
45	002192	融捷股份	22,450,768.20	3.03
46	603305	旭升集团	22,443,562.70	3.03
47	003029	吉大正元	22,435,133.51	3.02
48	300811	铂科新材	22,211,698.88	2.99
49	688187	时代电气	21,503,394.82	2.90
50	603728	鸣志电器	21,188,269.00	2.86
51	601615	明阳智能	20,977,399.88	2.83
52	002100	天康生物	20,754,815.00	2.80
53	002216	三全食品	20,437,563.59	2.76
54	300068	南都电源	20,298,440.20	2.74
55	300351	永贵电器	20,236,589.70	2.73
56	001205	盛航股份	20,083,137.82	2.71
57	688033	天宜上佳	19,539,532.87	2.63
58	000651	格力电器	19,027,322.00	2.57
59	600150	中国船舶	18,985,985.00	2.56
60	002891	中宠股份	18,910,224.10	2.55
61	002338	奥普光电	18,852,945.00	2.54
62	603529	爱玛科技	18,808,477.60	2.54
63	002567	唐人神	18,788,891.00	2.53
64	002698	博实股份	18,437,340.00	2.49
65	600111	北方稀土	18,372,463.54	2.48
66	002568	百润股份	18,273,675.00	2.46
67	601636	旗滨集团	18,132,449.04	2.44
68	300119	瑞普生物	18,068,737.00	2.44

69	600456	宝钛股份	17,847,138.97	2.41
70	603595	东尼电子	17,813,153.80	2.40
71	002707	众信旅游	17,692,182.00	2.39
72	300415	伊之密	16,928,771.00	2.28
73	002422	科伦药业	16,830,623.00	2.27
74	002498	汉缆股份	16,680,521.05	2.25
75	600486	扬农化工	16,586,487.32	2.24
76	601669	中国电建	16,416,380.00	2.21
77	689009	九号公司	16,013,598.43	2.16
78	002840	华统股份	15,798,301.00	2.13
79	601818	光大银行	15,671,459.12	2.11
80	000762	西藏矿业	15,506,039.00	2.09
81	002938	鹏鼎控股	15,441,608.67	2.08
82	002444	巨星科技	15,427,763.00	2.08
83	300251	光线传媒	15,240,548.27	2.05
84	600004	白云机场	15,229,226.28	2.05
85	688111	金山办公	15,153,378.59	2.04
86	603606	东方电缆	15,064,574.17	2.03
87	688680	海优新材	15,041,645.08	2.03
88	300360	炬华科技	14,998,884.00	2.02
89	300144	宋城演艺	14,991,247.11	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	6,227,515,525.18
卖出股票的收入（成交）总额	4,785,580,709.62

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	111,872,791.00	5.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	111,872,791.00	5.02

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	019629	20 国债 03	326,000	33,217,238.57	1.49
2	019674	22 国债 09	264,000	26,738,997.70	1.20
3	019666	22 国债 01	237,930	24,273,846.75	1.09
4	019679	22 国债 14	209,000	21,043,293.84	0.94
5	019688	22 国债 23	66,000	6,599,414.14	0.30

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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	1,734,308.44
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	40,407,218.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,141,527.08

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

本基金前十名股票未存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
中银主题策略 混合 A	16,802	27,396.37	411,727,973.70	89.4451 %	48,585,796.69	10.5549 %
中银主题策略 混合 C	5,348	24,045.52	119,989,106.04	93.3074 %	8,606,343.58	6.6926 %
合计	22,150	26,587.32	531,717,079.74	90.2885 %	57,192,140.27	9.7115 %

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从 业人员持有本基金	中银主题策略混合 A	2,419,017.69	0.5255%
	中银主题策略混合 C	55,719.42	0.0433%
	合计	2,474,737.11	0.4202%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占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、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	中银主题策略混合 A	10~50
	中银主题策略混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开 放式基金	中银主题策略混合 A	>100
	中银主题策略混合 C	0

	合计	>100
--	----	------

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中银主题策略混合 A	中银主题策略混合 C
基金合同生效日（2012 年 7 月 25 日）基金份额总额	895,045,013.12	-
本报告期期初基金份额总额	167,106,375.92	-
本报告期基金总申购份额	366,848,923.33	215,910,886.19
减：本报告期基金总赎回份额	73,641,528.86	87,315,436.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	460,313,770.39	128,595,449.62

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经董事会决议通过，陈卫星先生担任副执行总裁，详情请参见基金管理人 2022 年 6 月 7 日刊登的《中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，没有涉及基金财产、基金管理业务、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

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所，报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 40,000.00 元，目前事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为 10 年。

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没有受到监管部门稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	4,967,918,859.01	45.23%	4,587,449.50	45.13%	-
民生证券	1	2,097,499,162.35	19.10%	1,953,652.42	19.22%	-
东吴证券	1	1,721,570,412.44	15.67%	1,586,087.70	15.61%	-
东方证券	1	1,293,221,150.91	11.77%	1,204,559.10	11.85%	-
申万宏源	1	525,935,948.99	4.79%	484,049.69	4.76%	-
国信证券	2	377,290,071.63	3.44%	348,098.19	3.42%	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29 号）及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》有关规定，本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元并与其签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：新增民生证券上海交易席位一个、东吴证券深圳交易席位一个、兴业证券北京交易席位一个。

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		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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	56,645,037.29	45.70%	-	-	-	-
民生证券	20,908,111.00	16.87%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	39,373,676.00	31.76%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国信证券	7,026,887.10	5.67%	-	-	-	-

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	中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2022-01-01
2	中银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	中国证监会规定媒介	2022-01-05
3	中银基金管理有限公司关于新增诺亚正行基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-10
4	中银基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-13
5	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金估值变更的提示性公告	中国证监会规定媒介	2022-01-14
6	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西部证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-17
7	中银基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-18
8	中银基金管理有限公司关于新增泰信财	中国证监会规定媒介	2022-01-21

	富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	介	
9	中银主题策略混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-01-21
10	中银基金管理有限公司关于新增上海联泰基金销售有限公司为旗下部分证券投资基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-24
11	中银基金管理有限公司关于新增上海联泰基金销售有限公司为旗下部分证券投资基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-25
12	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天风证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-26
13	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华金证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-27
14	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申万宏源西部证券有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-07
15	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国中金财富证券有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-10
16	中银主题策略混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2022-03-16
17	中银主题策略混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2022-03-16
18	中银主题策略混合型证券投资基金（中银主题策略混合 A）产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2022-03-16
19	中银主题策略混合型证券投资基金更新招募说明书（2022 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2022-03-16
20	关于中银主题策略混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-16
21	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华宝证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-18
22	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东海证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-18
23	中银基金管理有限公司关于新增宜信普泽（北京）基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-24
24	中银基金管理有限公司关于新增宜信普泽（北京）基金销售有限公司为旗下部	中国证监会规定媒介	2022-03-25

	分基金销售机构的公告		
25	中银基金管理有限公司关于中银主题策略混合型证券投资基金增加平安证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-30
26	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加渤海证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-30
27	中银主题策略混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-03-30
28	中银基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-11
29	中银基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-16
30	中银基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-18
31	中银主题策略混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-21
32	中银基金管理有限公司关于为部分基金销售机构开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-06
33	中银基金管理有限公司关于为部分基金销售机构开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-09
34	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-27
35	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司同业易管家平台为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-27
36	中银基金管理有限公司关于新增泰信财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-06-02
37	中银基金管理有限公司关于新增泰信财富基金销售有限公司为部分基金开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-06
38	中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2022-06-07
39	中银基金管理有限公司关于新增嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-06-13
40	中银基金管理有限公司关于新增嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-06-14
41	中银基金管理有限公司董事、监事、高	中国证监会规定媒介	2022-06-21

	级管理人员和分支机构负责人的人员名单	介	
42	中银基金管理有限公司关于新增济安财富（北京）基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-21
43	中银基金管理有限公司关于新增济安财富（北京）基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-22
44	中银基金管理有限公司关于新增上海长量基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-07-07
45	中银基金管理有限公司关于新增上海长量基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-07-08
46	中银基金管理有限公司关于新增华宝证券股份有限公司为旗下部分产品销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-07-12
47	中银主题策略混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-07-20
48	中银基金管理有限公司关于新增西部证券股份有限公司为中银主题策略混合型证券投资基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-07-22
49	中银基金管理有限公司关于诺亚正行基金销售有限公司开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-07-28
50	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金在招商银行股份有限公司开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-08-05
51	中银基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会规定媒介	2022-08-16
52	中银主题策略混合型证券投资基金（中银主题策略混合 A）产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2022-08-17
53	中银主题策略混合型证券投资基金更新招募说明书（2022 年第 2 号）	中国证监会规定媒介	2022-08-17
54	中银基金管理有限公司关于办公电话变更的公告	中国证监会规定媒介	2022-08-18
55	中银主题策略混合型证券投资基金 2022 年中期报告	中国证监会规定媒介	2022-08-30
56	中银基金管理有限公司关于开展电子直销平台费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022-08-31
57	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司同业易管家平台为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-09-06
58	中银基金管理有限公司关于新增招商证券股份有限公司为旗下部分基金销售机	中国证监会规定媒介	2022-09-08

	构的公告		
59	中银基金管理有限公司关于中银主题策略混合型证券投资基金增加红塔证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-09-09
60	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金在兴业银行银银平台机构投资交易平台进行销售的公告	中国证监会规定媒介	2022-09-21
61	中银主题策略混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2022-10-25
62	中银基金管理有限公司关于新增国元证券股份有限公司为旗下部分产品销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-10-31
63	中银基金管理有限公司关于新增北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-03
64	中银基金管理有限公司关于新增北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-04
65	中银基金管理有限公司关于新增上海攀赢基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-11
66	中银基金管理有限公司关于新增上海攀赢基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-14
67	中银基金管理有限公司关于为部分基金销售机构开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-18
68	中银基金管理有限公司关于新增博时财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-22
69	中银基金管理有限公司关于新增博时财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-23
70	中银基金管理有限公司关于新增东方证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-28
71	中银基金管理有限公司关于新增平安银行股份有限公司行 E 通平台为旗下部分基金销售机构及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-29
72	中银基金管理有限公司关于新增海通证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-30
73	中银基金管理有限公司关于新增海通证券股份有限公司为旗下部分基金销售机	中国证监会规定媒介	2022-12-01

	构的公告		
74	中银基金管理有限公司关于新增国泰君安证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-12-02
75	中银基金管理有限公司关于设立新加坡子公司及获批相关业务牌照的公告	中国证监会规定媒介	2022-12-09
76	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-12-20

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中银主题策略混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《中银主题策略混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银主题策略混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中银主题策略混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人互联网站。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

中银基金管理有限公司
二〇二三年三月三十日