中信证券信远一年持有期混合型集合资产管理计划

2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：中信证券股份有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年七月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中信证券信远一年		
基金主代码	900027		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021 年 3 月 31 日		
报告期末基金份额总额	98,621,166.65 份		
投资目标	本集合计划在严格控制风险的前提下，主要投资于 A 股及港股通范围内具有明显竞争优势且质地良好的上市公司，力争实现集合计划的长期稳健增值。		
投资策略	根据对宏观经济、市场面、 政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券及其他金融工具的比例。主要投资策略有：大类资产配置策略、权益类资产投资策略、债权类资产投资策略和衍生品投资策略等。		
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（经汇率调整）×20%+中债综合财富指数收益率×20%		
风险收益特征	本集合计划为混合型集合计划，其风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。		
基金管理人	中信证券股份有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	中信证券信远一年 A	中信证券信远一年 B	中信证券信远一年 C
下属分级基金的交易代码	900027	900077	900087
报告期末下属分级基金的份额总额	95,510,525.95 份	751,378.61 份	2,359,262.09 份

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)		
	中信证券信远一年 A	中信证券信远一年 B	中信证券信远一年 C
1. 本期已实现收益	-6,751,209.16	-52,787.92	-164,641.28
2. 本期利润	-3,185,418.64	-24,697.01	-77,168.52
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0333	-0.0330	-0.0334
4. 期末基金资产净值	65,426,492.67	514,699.04	1,602,035.05
5. 期末基金份额净值	0.6850	0.6850	0.6790

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。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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

中信证券信远一年A：

阶段	净值增长率①	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	-4.61%	1.40%	5.06%	1.14%	-9.67%	0.26%
过去六个月	-13.87%	1.30%	-5.36%	1.21%	-8.51%	0.09%
过去一年	-22.51%	1.41%	-11.87%	1.02%	-10.64%	0.39%
自基金合同生效起至今	-9.74%	1.40%	-10.35%	0.96%	0.61%	0.44%

中信证券信远一年B：

阶段	净值增长率①	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	-4.61%	1.40%	5.06%	1.14%	-9.67%	0.26%
过去六个月	-13.86%	1.30%	-5.36%	1.21%	-8.50%	0.09%
过去一年	-22.51%	1.42%	-11.87%	1.02%	-10.64%	0.40%
自基金合同生效起至今	-9.74%	1.40%	-10.35%	0.96%	0.61%	0.44%

中信证券信远一年C：

阶段	净值增长率①	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	-4.81%	1.40%	5.06%	1.14%	-9.87%	0.26%
过去六个月	-14.20%	1.30%	-5.36%	1.21%	-8.84%	0.09%
过去一年	-23.11%	1.42%	-11.87%	1.02%	-11.24%	0.40%
自基金合同生效起至今	-10.53%	1.40%	-10.35%	0.96%	-0.18%	0.44%

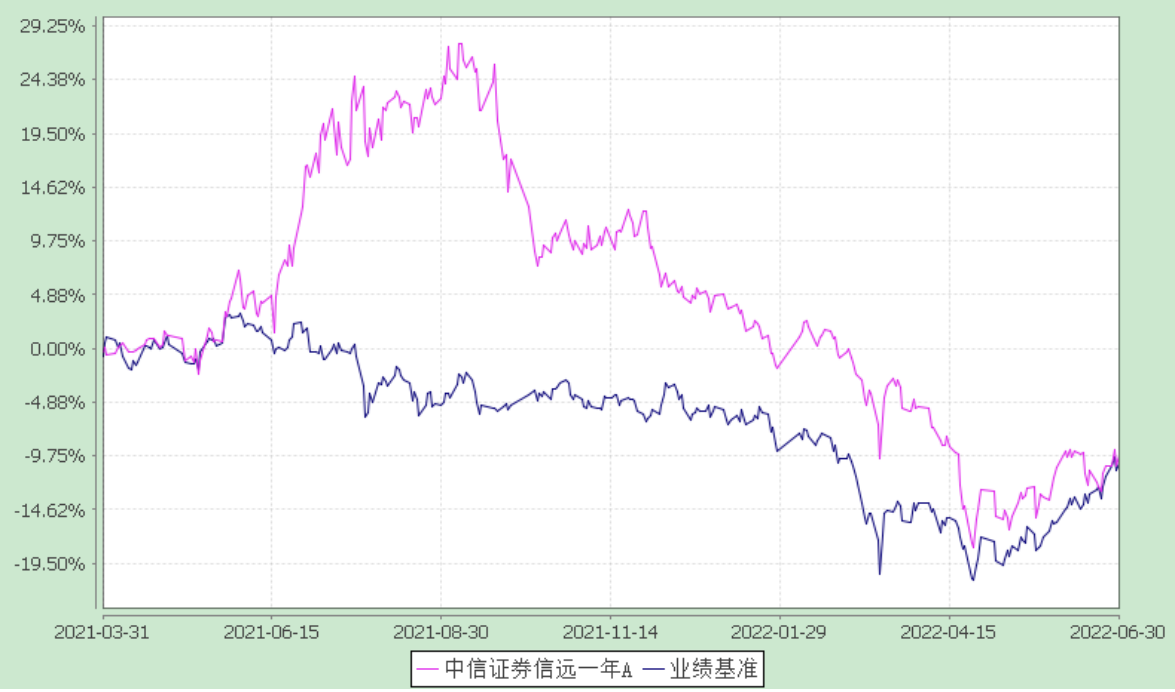
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中信证券信远一年持有期混合型集合资产管理计划

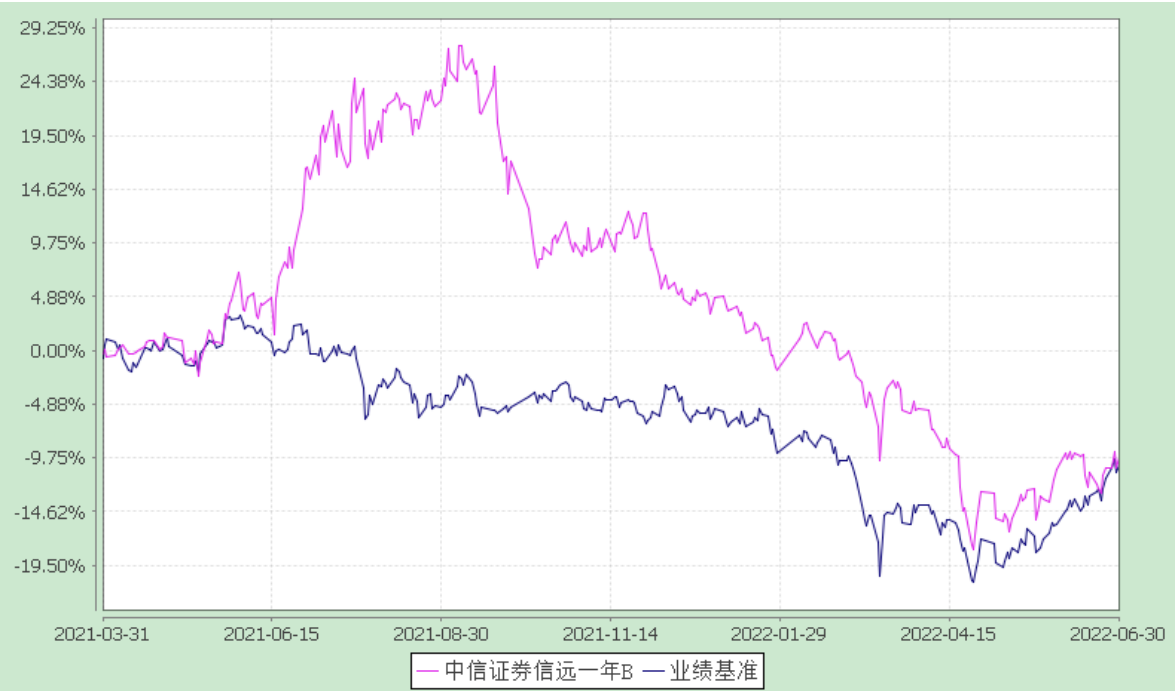
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021 年 3 月 31 日至 2022 年 6 月 30 日)

中信证券信远一年A：



中信证券信远一年B：



中信证券信远一年C：

§4 管理人报告

4.1基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡青	本基金的基金经理	2021-03-31	-	12	英国朴茨茅斯大学金融决策分析专业硕士。2018 年 1 月加入中信

					证券资产管理部，此前曾任南方基金国际业务部高级研究员、基金经理，现任中信证券资产管理业务执行总经理、跨境业务负责人。蔡青女士长期从事跨境权益资产研究及投资工作，具备丰富的投资研究经验。

注：(1)基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期；

(2)非首任基金经理，其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

(3)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)依据《证券业从业人员资格管理常见问题解答》，从业年限满 12 个月算一年，不满一年向下取整。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
蔡青	公募基金	2	598,552,000.07	2015 年 05 月 28 日
	私募资产管理计划	5	1,420,262,288.04	2018 年 07 月 01 日
	其他组合	1	209,656,126.81	2021 年 04 月 16 日
	合计	8	2,228,470,414.92	

注：任职时间为投资经理在行业内首次管理本类产品的时间。

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，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投

资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《中信证券股份有限公司资产管理业务公平交易制度》的规定。

4.3.2异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 22 年 2 季度，A 股市场方面，市场在 4 月延续了一定的下跌趋势后，主要指数在 5、6 月发生了一定的反弹，其中涨幅靠前的包括了沪深 300、创业板指数等，科创板指数相对而言涨幅靠后，从行业层面看，汽车、食品饮料、家用电器等板块均发生了一定的涨幅，计算机、传媒、地产等行业发生了一定的跌幅。港股市场方面，恒生指数仍然处于一定的震荡中，恒生科技指数在一季度的下跌后发生了一定的涨幅，行业上看，消费、医疗等行业领涨，原材料、电讯、公用事业等板块发生了一定的跌幅和调整。本季度，产品的净值发生了一定的跌幅，目前组合持仓基本保持稳定，继续持有工业、能源等板块的配置。

展望后市，一方面，中国的通胀水平低于欧美发达国家，随着中国政策逐步发力以及上海、北京等主要城市从疫情的影响中复苏，中国市场将展现更强的韧性。另一方面，短期内市场仍然存在一定的不确定性，目前政策对于就业、消费以及投资的支持力度也在进一步发力的过程中，稳定经济增长的重要性仍然在突出位置。短期内，政策支撑持续发力，市场流动性放松存在持续的可能，市场可能在震荡中继续修复。从中长期看，科技创新、高端制造、消费医疗等领域发展空间广阔，我们将继续遵循基本面研究驱动，自下而上选择估值合理、符合收益预期的潜在投资机会。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 06 月 30 日，中信证券信远一年 A 基金份额净值为 0.6850 元，本报告期份额净值增长率为-4.61%;中信证券信远一年 B 基金份额净值为 0.6850 元，本报告期份额净值增长率为-4.61%;中信证券信远一年 C 基金份额净值为 0.6790 元，本报告期份额净值增长率为-4.81%，同期业绩比较基准增长率为 5.06%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金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 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	45,106,279.07	66.40
	其中：股票	45,106,279.07	66.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,893,209.66	5.73
	其中：债券	3,893,209.66	5.73
	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	18,127,341.05	26.68
8	其他各项资产	807,385.65	1.19
9	合计	67,934,215.43	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 11,582,418.98 元，占期末净值比例为 17.15%。

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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	5,705,323.00	8.45
C	制造业	25,707,127.09	38.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,111,410.00	3.13
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	33,523,860.09	49.63

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
公用事业	5,950,849.22	8.81
能源	5,631,569.76	8.34
合计	11,582,418.98	17.15

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	00384	中国燃气	574,800.00	5,950,849.22	8.81
2	01171	兖矿能源	268,000.00	5,631,569.76	8.34
3	600765	中航重机	112,720.00	3,627,329.60	5.37
4	688390	固德威	10,454.00	3,272,206.54	4.84
5	688063	派能科技	9,658.00	3,015,227.60	4.46
6	301031	中熔电气	16,700.00	2,394,446.00	3.55
7	688037	芯源微	15,055.00	2,182,523.35	3.23
8	601001	晋控煤业	122,300.00	2,170,825.00	3.21
9	600546	山煤国际	108,500.00	2,111,410.00	3.13
10	002709	天赐材料	32,700.00	2,029,362.00	3.00

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,893,209.66	5.76
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	公司债	-	-
10	地方债	-	-
11	定向工具	-	-
12	其他	-	-
13	合计	3,893,209.66	5.76

5.5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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019666	22 国债 01	38,500.00	3,893,209.66	5.76

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11投资组合报告附注

5.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体中，山煤国际能源集团股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。该类情形对上市公司的经营和财务没有重大影响，该证券的投资决策程序符合相关法律法规以及基金合同的要求。

5.11.2 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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	671,312.78
3	应收股利	135,584.10
4	应收利息	-
5	应收申购款	488.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	807,385.65

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信证券信远一年 A	中信证券信远一年 B	中信证券信远一年 C
基金合同生效日基金份额总额	102,669,020.99	-	-
本报告期期初基金份额总额	95,988,689.21	745,369.67	2,287,109.66
报告期期间基金总申购份额	-	6,008.94	72,152.43
减：报告期期间基金总赎回份额	478,163.26	-	-
报告期期间基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	95,510,525.95	751,378.61	2,359,262.09

注：基金合同生效日：2021 年 03 月 31 日

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	中信证券信远一年 A	中信证券信远一年 B	中信证券信远一年 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	13,958,452.48	-	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	13,958,452.48	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	14.15	-	-

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022 年 04 月 01 日-2022 年 06 月 30 日	49,519,806.44	0.00	0.00	49,519,806.44	50.21%
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

8.2影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会同意合同变更的文件；

2、中信证券信远一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同；

3、中信证券信远一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议；

4、中信证券信远一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书及其更新；

5、管理人业务资格批件、营业执照；

6、托管人业务资格批件、营业执照；

7、报告期内披露的各项公告。

9.2存放地点

北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 16 层。

9.3查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95548

公司网址：http://www.cs.ecitic.com

中信证券股份有限公司

二〇二二年七月二十一日