

# 中信建投价值增长混合型集合资产管理计划

## 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：中信建投证券股份有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本集合计划资产管理合同规定，于 2024 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
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 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	21
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 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	47

7.7 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 .....	47
7.8 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 .....	47
7.9 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 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
8.3 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 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
10.2 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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>
11.1 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 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投价值增长混合型集合资产管理计划	
基金简称	中信建投价值增长	
基金主代码	970016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 月 7 日	
基金管理人	中信建投证券股份有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	966,744,524.88 份	
基金合同存续期	本集合计划自集合计划合同变更生效日起存续期至 2024 年 12 月 31 日。本集合计划自 2024 年 12 月 31 日后，按照中国证监会相关规定执行。	
下属分级基金的基金简称	中信建投价值增长 A	中信建投价值增长 C
下属分级基金的交易代码	970016	970017
报告期末下属分级基金的份额总额	825,603,445.26 份	141,141,079.62 份

注：本报告所述“基金”系按照《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》的要求完成变更后的证券公司大集合产品，中信建投价值增长混合型集合资产管理计划在本报告简称“本基金”或“本集合计划”，《中信建投价值增长混合型集合资产管理计划资产管理合同》在本报告简称“本基金合同”或“本集合计划资产管理合同”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以“价值增长”为投资策略主线，聚焦精选赛道、精选个股，通过定量和定性分析筛选质地优秀的公司，并结合长期持有的操作思路，充分分享中国优质企业的成长，在严格控制风险的前提下，力争实现资产的长期稳定增值。
投资策略	本集合计划将通过跟踪宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、PPI 走势、M2 变化、利率水平等）以及各项国家政策变化（包括财政、货币政策等）来判断当前宏观经济周期所处的位置以及未来发展的方向，在此基础上分析判断权益市场、债券市场、货币市场的预期收益与风险，并据此进行大类资产配置和组合构建，合理确定本集合计划在权益、债券、现金等金融工具上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各资产投资比例。 主要投资策略有股票投资策略、债券投资策略等。
业绩比较基准	70%*沪深 300 指数收益率+30%*一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本集合计划为混合型集合资产管理计划，其预期收益和预期风险通常高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。

注：详见《中信建投价值增长混合型集合资产管理计划资产管理合同》第十一部分“集合计划的投资”。

### 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		中信建投证券股份有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张昕帆	罗丹丹
	联系电话	400-888-8108	400-680-0000
	电子邮箱	fund_zg@csc.com.cn	luodandan@citicbank.com
客户服务电话		400-888-8108	95558
传真		010-84651186	010-85230024
注册地址		北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		北京市朝阳区光华路 10 号	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		100020	100026
法定代表人		王常青	方合英

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csc108.com">http://www.csc108.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	中信建投价值增长 A	中信建投价值增长 C
本期已实现收益	-89,683,004.45	-15,666,110.50
本期利润	-156,324,068.44	-26,865,100.47
加权平均基金份 额本期利润	-0.1835	-0.1828
本期加权平均净 值利润率	-19.14%	-19.56%
本期基金份额净 值增长率	-17.07%	-17.41%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利 润	-279,399,902.38	-19,646,290.75
期末可供分配基 金份额利润	-0.3384	-0.1392
期末基金资产净 值	730,795,001.41	121,494,788.87
期末基金份额净 值	0.8852	0.8608
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净 值增长率	-53.27%	-54.56%

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

2. 期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

3. 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

中信建投价值增长 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
过去一个月	-8.35%	0.95%	-2.28%	0.34%	-6.07%	0.61%
过去三个月	-8.41%	1.20%	-1.37%	0.53%	-7.04%	0.67%
过去六个月	-17.07%	1.43%	0.94%	0.63%	-18.01%	0.80%
过去一年	-24.80%	1.18%	-6.46%	0.61%	-18.34%	0.57%
过去三年	-58.24%	1.17%	-23.40%	0.73%	-34.84%	0.44%
自基金合同生效起至今	-53.27%	1.13%	-21.35%	0.76%	-31.92%	0.37%

中信建投价值增长 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
过去一个月	-8.41%	0.95%	-2.28%	0.34%	-6.13%	0.61%
过去三个月	-8.60%	1.20%	-1.37%	0.53%	-7.23%	0.67%
过去六个月	-17.41%	1.43%	0.94%	0.63%	-18.35%	0.80%
过去一年	-25.41%	1.18%	-6.46%	0.61%	-18.95%	0.57%
过去三年	-59.24%	1.17%	-23.40%	0.73%	-35.84%	0.44%
自基金合同生效起至今	-54.56%	1.13%	-21.35%	0.76%	-33.21%	0.37%



### 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

中信建投价值增长A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中信建投价值增长C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本集合计划资产管理合同生效日为 2020 年 12 月 7 日。根据资产管理合同的约定，管理人应当自集合计划资产管理合同生效之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合资产管理合同的有关约定。本集合计划在建仓期结束时各项资产配置比例符合资产管理合同的要求。

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

## § 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

中信建投证券股份有限公司（以下简称“中信建投证券”或“公司”）是经中国证监会批准设立的大型国有综合证券公司。中信建投证券成立于 2005 年 11 月 2 日，注册地为北京。2016 年 12 月 9 日，中信建投证券在香港联交所正式挂牌交易，股票代码为 6066.HK。2018 年 6 月 20 日，中信建投证券在上海证券交易所正式挂牌交易，股票代码为 601066.SH。

中信建投证券于 2009 年 6 月 29 日获得中国证监会批复的客户资产管理业务资格，并于 2013 年 5 月获得中国保监会批复的投资管理人受托管理保险资金资格。

中信建投证券根据《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，完成“中信建投精彩理财灵活配置集合资产管理计划”的规范验收及合同变更，变更后的产品名称为“中信建投价值增长混合型集合资产管理计划”。

截至 2024 年 6 月 30 日，中信建投证券共管理 5 只参照公募基金运作的大集合资产管理计划：中信建投价值增长混合型集合资产管理计划、中信建投智多鑫货币型集合资产管理计划、中信建投悠享 12 个月持有期债券型集合资产管理计划、中信建投悦享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划以及中信建投欣享债券型集合资产管理计划。

#### 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		
黄侃	本基金的基金经理	2022 年 3 月 1 日	2024 年 1 月 29 日	13 年	硕士研究生，具备基金从业资格。2010 年加入中信建投证券，任资产管理部研究员，负责大消费行业的研究。2017 年起担任投资经理。
张燕	本基金的基金经理、中信建投证券资产管理部公募投资部联席负责人	2023 年 8 月 10 日	-	12 年	硕士研究生，具备基金从业资格。2011 年 7 月至 2015 年 5 月任职新华基金管理有限公司研究部，担任基金经理助理兼研究员。2015 年 5 月至 2016 年 11 月任职中欧基金管理有限公司，历任中欧成长优选回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理（2015 年 5 月 25 日至 2016 年 11 月 17 日期间）、中欧价值发现混合型证券投资基金基金经理（2015 年 5 月 29 日至 2016 年 11 月 17 日期间）、中欧潜力价值灵活配置

					<p>混合型证券投资基金基金经理（2015 年 9 月 30 日至 2016 年 11 月 17 日期间）。2016 年 11 月至 2017 年 10 月任职中国人寿养老保险股份有限公司投资中心，担任高级权益投资经理。2017 年 10 月加入中银国际证券股份有限公司，历任中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2018 年 1 月 31 日至 2019 年 2 月 11 日期间）、中银证券瑞丰定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2018 年 1 月 19 日至 2019 年 5 月 25 日期间）、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2018 年 1 月 19 日至 2019 年 7 月 6 日期间）、中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2018 年 1 月 19 日至 2023 年 1 月 14 日期间）、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2018 年 8 月 24 日起至 2023 年 1 月 14 日期间）、中银证券远见价值混合型证券投资基金基金经理（2021 年 12 月 24 日至 2023 年 1 月 14 日期间）。2023 年 2 月加入中信建投证券，自 2023 年 8 月 10 日起担任中信建投价值增长混合型集合资产管理计划基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：1. 对集合计划的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期；

2. 证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 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

注：无。

#### 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》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，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，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 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人根据《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《中信建投证券股份有限公司资产管理业务公平交易管理规定》。本集合计划管理人通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，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对公平交易过程和结果的监督。

报告期内，本集合计划管理人严格执行了公平交易机制，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，交易执行环节对各类交易严格控制流程，确保了公平交易原则的实现。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本集合计划存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本集合计划的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，市场风险偏好大幅回落，个股中位数跌幅较大，同时风格分化加剧，给投资带来了诸多挑战。我们始终秉持逆向价值投资风格，在复杂多变的市场环境中努力寻找被低估的优质资产，以期实现基金资产的稳健增值。

上半年不同行业间以及大小盘股票之间表现分化尤为明显，估值差距不断扩大，仅少数热门板块受到资金的抱团追捧，导致市场的有效性受到一定程度的扭曲，也使得投资决策更加困难。

我们认为，当市场过度关注短期的增长和热门题材时，可能会忽略企业的内在价值和长期竞争力。从库存周期来看，当前市场处在 2009 年以来第六轮库存周期的补库阶段。当前市场估值总体处在历史低位，中期配置价值突出；行业间分化较大，大小盘风格演绎较为充分；从均值回归的角度来看，中期持有可能是较好的策略。着眼于基本面，我们后续仍关注需求相对刚性、供给收缩、景气反转的畜禽养殖、去库存较充分的顺周期子板块以及需求稳健的消费板块，并跟踪挖掘第六轮人工智能创新周期有望取得应用突破的垂直应用领域。

展望未来，我们认为市场风格的分化仍可能持续，但逆向价值投资的机会也将不断涌现。我们将继续坚守投资理念，不断提升研究能力和投资水平，为投资者寻找更多具有潜在价值的投资标的，努力实现基金资产的持续稳健增长。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，中信建投价值增长 A 基金份额净值为 0.8852 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.07%；截至本报告期末，中信建投价值增长 C 基金份额净值为 0.8608 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.41%；业绩比较基准收益率为 0.94%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前国内经济温和复苏，内需不足和地缘政治不友好等因素给宏观经济和证券市场带来了诸多挑战，但当前市场的低位估值也孕育着市场潜在的机会。

从宏观经济层面来看，内循环受阻成为了经济增长的主要制约因素。在房价下跌的财富效应以及收入预期较悲观等共同作用下，内需被压制。消费作为经济增长的重要引擎，其动力略显疲软。就业形势的不确定性、收入增长的放缓以及对未来经济预期的谨慎态度等因素影响了居民消费意愿。这不仅对消费相关行业造成了直接冲击，也在一定程度上影响了整体经济的活跃度和复苏程度。与此同时，地缘政治也给宏观经济增添了诸多不确定性，贸易摩擦的反复、国际关系的紧张以及部分地区的冲突升级，都对全球经济格局和贸易往来产生了负面影响。这使得国际贸易环境复杂多变，企业面临着供应链受阻、市场需求波动等问题，进一步增加了宏观经济的下行压力。

从证券市场的角度来看，当前市场的低位估值或许为投资者提供了难得的布局时机。尽管市场整体表现较为低迷，但一些优质资产的价值被低估，具备了长期投资的性价比。随着经济逐渐复苏和市场信心的修复，这些被低估的资产有望迎来价值回归。

在行业走势方面，内需相关行业如消费、零售等，在短期内可能仍面临一定的困境，但预计随着政策的支持和消费环境的改善，有望在未来逐步回暖。同时，新基建、科技创新等领域则具有较强的发展潜力，科技创新领域不断涌现的新技术、新模式也将催生新的投资机会。此外，在当前的宏观经济背景下，具有稳定现金流和抗风险能力的行业，如公用事业、必需消费品等，也值得投资者关注。这些行业通常能够在经济波动中保持相对稳定的业绩，可能为投资提供一定的防御性机会。

综上，尽管当前宏观经济面临内需不足和地缘政治等诸多挑战，但市场低位估值也为证券市场带来了潜在的投资机会，我们继续保持理性和耐心。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值工作小组，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集

合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 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

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日份额持有人数量不满两百人或者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

作为本集合计划的托管人，中信银行股份有限公司严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划资产管理合同和托管协议的规定，对中信建投价值增长混合型集合资产管理计划本报告期的投资运作进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害集合资产管理计划份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中信建投证券在中信建投价值增长混合型集合资产管理计划的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害中信建投价值增长混合型集合资产管理计划份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照集合计划资产管理合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中信建投证券的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，集合计划管理人所编制和披露的 2024 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中信建投价值增长混合型集合资产管理计划

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	85,953,251.92	87,735,169.33
结算备付金		584,071.10	326,767.18
存出保证金		176,064.33	174,660.06
交易性金融资产	6.4.7.2	769,083,791.60	1,029,363,123.23
其中：股票投资		769,083,791.60	1,029,363,123.23
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		3,003,200.61	-
应收股利		-	-
应收申购款		12,094.72	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		858,812,474.28	1,117,599,719.80
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		550,129.23	12,665,751.24



应付赎回款		720,871.33	1,633,789.62
应付管理人报酬		885,078.69	1,121,452.09
应付托管费		162,264.42	205,599.56
应付销售服务费		3,135,639.95	3,494,326.16
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,068,700.38	456,611.53
负债合计		6,522,684.00	19,577,530.20
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	966,744,524.88	1,032,278,491.57
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-114,454,734.60	65,743,698.03
净资产合计		852,289,790.28	1,098,022,189.60
负债和净资产总计		858,812,474.28	1,117,599,719.80

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，本集合计划份额总额为：966,744,524.88 份，其中

中信建投价值增长 A 集合计划份额为：825,603,445.26 份，集合计划份额净值为：0.8852 元。

中信建投价值增长 C 集合计划份额为：141,141,079.62 份，集合计划份额净值为：0.8608 元。

## 6.2 利润表

会计主体：中信建投价值增长混合型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-175,814,366.77	-118,597,974.00
1. 利息收入		541,962.67	833,715.24
其中：存款利息收入	6.4.7.13	541,962.67	833,715.24
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-98,521,543.08	14,138,962.44
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-106,270,840.96	6,279,299.40

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	7,749,297.88	7,859,663.04
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)	6.4.7.20	-77,840,053.96	-133,582,883.28
4. 汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.7.21	5,267.60	12,231.60
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>7,374,802.14</b>	<b>12,073,508.56</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,689,533.74	8,944,202.06
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,043,081.13	1,639,770.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	545,962.24	935,334.87
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	166,605.51
8. 其他费用	6.4.7.23	96,225.03	387,595.71
<b>三、利润总额(亏损总 额以“-”号填列)</b>		<b>-183,189,168.91</b>	<b>-130,671,482.56</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以 “-”号填列)</b>		<b>-183,189,168.91</b>	<b>-130,671,482.56</b>
<b>五、其他综合收益的税 后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-183,189,168.91</b>	<b>-130,671,482.56</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中信建投价值增长混合型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	1,032,278,491.57	-	65,743,698.03	1,098,022,189.60
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,032,278,491.57	-	65,743,698.03	1,098,022,189.60
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-65,533,966.69	-	-180,198,432.63	-245,732,399.32
(一)、综合收益总额	-	-	-183,189,168.91	-183,189,168.91
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-65,533,966.69	-	2,990,736.28	-62,543,230.41
其中：1. 基金申购款	3,120,890.67	-	-168,153.70	2,952,736.97
2. 基金赎回款	-68,654,857.36	-	3,158,889.98	-65,495,967.38
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	966,744,524.88	-	-114,454,734.60	852,289,790.28
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	1,252,647,799.72	-	357,973,619.75	1,610,621,419.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,252,647,799.72	-	357,973,619.75	1,610,621,419.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-132,049,713.17	-	-163,321,882.41	-295,371,595.58
(一)、综合收益总额	-	-	-130,671,482.56	-130,671,482.56
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-132,049,713.17	-	-32,650,399.85	-164,700,113.02
其中：1. 基金申购款	5,301,550.82	-	1,319,126.66	6,620,677.48
2. 基金赎回款	-137,351,263.99	-	-33,969,526.51	-171,320,790.50
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,120,598,086.55	-	194,651,737.34	1,315,249,823.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张昕帆

李志山

李志山

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中信建投价值增长混合型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)是由中信建投精彩理财灵活配置集合资产管理计划转型而来。本集合计划的管理人中信建投证券于 2020 年 11 月 20 日发布《关于中信建投精彩理财灵活配置集合资产管理计划变更的公告》。根据公告,中信建投精彩理财灵活配置集合资产管理计划名称变更为“中信建投价值增长混合型集合资产管理计划”,中信建投精彩理财灵活配置集合资产管理计划份额转换为中信建投价值增长混合型集合资产管理计划 A 类份额。合同变更后,本集合计划的托管人、登记机构不变。自 2020 年 12 月 7 日起,《中信建投价值增长混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《中信建投价值增长混合型集合资产管理计划托管协议》生效。本集合计划自集合计划合同变更生效日起存续期至 2024 年 12 月 31 日,期限届满后,按照中国证监会有关规定执行。本集合计划的管理人为中信建投证券,托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投价值增长混合型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定,本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包括主板、中小板、创业板以及其他中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准上市的股票)、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、通知存款、协议存款等)、同业存单、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本集合计划的投资组合比例为:股票资产的投资比例为集合计划资产的 50%-95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计划的业绩比较基准为:70%×沪深 300 指数收益率+30%×一年期银行定期存款利率(税后)。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划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》、《中信建投价值增长混合型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日的经营成果和集合计划净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本期财务报表所采用的会计政策与编制 2023 年年度财务报表所采用的会计政策一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

财政部、国家税务总局《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36 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〔2016〕140 号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税〔2017〕2 号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税〔2017〕56 号)及《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90 号)对增值税做出相关规定。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，自 2018 年 1 月 1 日(含)起，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

##### (1) 增值税

根据财税〔2016〕140 号文件的规定，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。

根据财税〔2017〕56 号文件的规定，自 2018 年 1 月 1 日(含)起，资管产品管理人(以下称管

理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财税(2017)90 号文件的规定,自 2018 年 1 月 1 日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:(一)提供贷款服务,以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;(二)转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本集合计划增值税的附加税费,包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等,按照实际缴纳增值税税额的适用比例计算,由管理人申报缴纳。

#### (2) 印花税

根据《中华人民共和国印花税法》(2022 年 7 月 1 日起施行),证券交易印花税对证券交易的出让方征收,不对受让方征收。证券交易印花税按成交金额的千分之一计算,证券登记结算机构为证券交易印花税的扣缴义务人。计划管理人运用资产管理计划买卖股票,卖出股票按 1%的税率缴纳证券交易印花税,买入股票不征收证券交易印花税。根据《关于减半征收证券交易印花税的公告》(财政部税务总局公告 2023 年第 39 号),自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	85,953,251.92
等于: 本金	85,924,957.64
加: 应计利息	28,294.28
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	85,953,251.92

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,058,936,446.87	-	769,083,791.60	-289,852,655.27
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	1,058,936,446.87	-	769,083,791.60	-289,852,655.27

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本集合计划本报告期末无衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本集合计划本报告期末无期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本集合计划本报告期末无黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本集合计划本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本集合计划本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。



#### 6.4.7.5 其他资产

注：本集合计划本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	14.95
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	912,836.29
其中：交易所市场	912,836.29
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	59,672.34
预提审计费	96,176.80
合计	1,068,700.38

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 中信建投价值增长 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	879,731,603.54	879,731,603.54
本期申购	2,602,590.13	2,602,590.13
本期赎回（以“-”号填列）	-56,730,748.41	-56,730,748.41
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	825,603,445.26	825,603,445.26

##### 中信建投价值增长 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	152,546,888.03	152,546,888.03
本期申购	518,300.54	518,300.54
本期赎回（以“-”号填列）	-11,924,108.95	-11,924,108.95
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	141,141,079.62	141,141,079.62
-----	----------------	----------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中信建投价值增长 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-205,870,282.44	265,178,591.97	59,308,309.53
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-205,870,282.44	265,178,591.97	59,308,309.53
本期利润	-89,683,004.45	-66,641,063.99	-156,324,068.44
本期基金份额交易产生的变动数	16,153,384.51	-13,946,069.45	2,207,315.06
其中：基金申购款	-787,890.32	656,385.49	-131,504.83
基金赎回款	16,941,274.83	-14,602,454.94	2,338,819.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-279,399,902.38	184,591,458.53	-94,808,443.85

中信建投价值增长 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	37,522,848.83	-31,087,460.33	6,435,388.50
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	37,522,848.83	-31,087,460.33	6,435,388.50
本期利润	-15,666,110.50	-11,198,989.97	-26,865,100.47
本期基金份额交易产生的变动数	-2,030,449.32	2,813,870.54	783,421.22
其中：基金申购款	91,357.28	-128,006.15	-36,648.87
基金赎回款	-2,121,806.60	2,941,876.69	820,070.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,826,289.01	-39,472,579.76	-19,646,290.75

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	535,054.84
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,658.24
其他	1,249.59

合计	541,962.67
----	------------

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-106,270,840.96
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-106,270,840.96

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	609,865,610.63
减：卖出股票成本总额	714,845,438.77
减：交易费用	1,291,012.82
买卖股票差价收入	-106,270,840.96

注：卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中增值税的影响。

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本集合计划本报告期无证券出借差价收入。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

注：本集合计划本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本集合计划本报告期无买卖债券差价收入。

##### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期无赎回债券差价收入。

##### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期无申购债券差价收入。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本集合计划本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期无赎回资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期无申购资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

##### 6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

注：本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本集合计划本报告期无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期无赎回贵金属差价收入。

##### 6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期无申购贵金属差价收入。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本集合计划本报告期无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本集合计划本报告期无衍生工具其它投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,749,297.88
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	7,749,297.88

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-77,840,053.96
股票投资	-77,840,053.96
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-77,840,053.96

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	5,267.60
合计	5,267.60

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	36,176.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	375.89
合计	96,225.03

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划不存在须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本集合计划不存在须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本集合计划本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信建投证券股份有限公司（“中信建投证券”）	基金管理人、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金销售机构
中信建投期货有限公司（“中信建投期货”）	基金销售机构、基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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（%）
中信建投证券股份有限公司	1,142,271,771.73	100.00	5,945,692,484.95	100.00

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30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 (%)
中信建投证券股 份有限公司	912,836.29	100.00	912,836.29	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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 (%)
中信建投证券股 份有限公司	4,756,554.12	100.00	232,296.30	100.00

注：上述佣金参考市场价格经本集合计划的集合计划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。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本集合计划提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	5,689,533.74
其中：应支付销售机构的客户维护 费	449,976.77	699,440.29
应支付基金管理人的净管理费	3,722,457.99	5,865,737.08

注：1、本集合计划支付集合计划管理人中信建投证券的管理人报酬按前一日集合计划资产净值的1.20%年费率计提，每日计提，按月支付。日管理费=前一日的集合计划资产净值×1.20%/当年天数。

2、本集合计划管理人收取业绩报酬。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	1,043,081.13

注：本集合计划支付托管人中信银行的托管费按前一日集合计划资产净值的0.22%的年费率计提，

每日计提，按月支付。日托管费=前一日的集合计划资产净值×0.22%/当年天数。

### 6.4.10.2.3 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 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投价值增长 A	中信建投价值增长 C	合计
中信建投期货有限公司	-	1,775.74	1,775.74
中信建投证券股份有限公司	-	317,558.91	317,558.91
中信银行股份有限公司	-	103,313.17	103,313.17
合计	-	422,647.82	422,647.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投价值增长 A	中信建投价值增长 C	合计
中信建投期货有限公司	-	4,464.77	4,464.77
中信建投证券股份有限公司	-	549,493.33	549,493.33
中信银行股份有限公司	-	181,063.27	181,063.27
合计	-	735,021.37	735,021.37

注：支付销售机构的销售服务费按前一日 C 类集合计划资产净值的 0.80% 的年费率每日计提。其计算公式为：C 类份额日销售服务费=C 类份额前一日的集合计划资产净值×0.80%/当年天数。本集合计划 A 类份额不收取销售服务费。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 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

#### 6.4.10.4.1 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

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间未发生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。



#### 6.4.10.4.2 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

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间未发生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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	中信建投价值增长 A	中信建投价值增长 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 7 日）持有的基金份额	1,840,289.91	-
报告期初持有的基金份额	25,738,100.83	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	25,738,100.83	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.6623%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	中信建投价值增长 A	中信建投价值增长 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 7 日）持有的基金份额	1,840,289.91	-
报告期初持有的基金份额	25,738,100.83	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	25,738,100.83	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.3000%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

#### 6.4.10.5.2 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

注：报告期末除集合计划管理人之外的其他关联方未发生投资本集合计划的情况。

#### 6.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	85,953,251.92	535,054.84	106,424,412.93	791,290.04

注：本集合计划的银行存款由托管人中信银行股份有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间未在承销期内申购关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本集合计划本报告期无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本集合计划本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日，本集合计划无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本集合计划本报告期末未有转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本集合计划管理人制定了相应的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。

本集合计划管理人建立了由风险管理部、稽核审计部、法律合规部组成的风险控制职能部门，独立开展对业务和相关操作的风险评价。风险管理部、稽核审计部、法律合规部等互相配合，建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险监控。此外，业务部门也建立了自身的内部控制机制，主要由授权体系和业务后台部门信息监控机制组成。

本集合计划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，根据本集合计划的投资目标，结合集合计划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。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。

本集合计划的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。本集合计划的银行活期存款存放在托管人中信银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。对于买入返售等业务，本集合计划的管理人主要考虑同业规模、财务状况及内外部信用风险评级结果确定交易对手的信用情况，对手方信用风险由本集合计划的管理人定期统一审查，实行额度管理。本集合计划在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本集合计划管理人采用预期信用损失模型评估以摊余成本计量的金融资产的减值损失。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指无法通过变现资产等途径以合理成本及时获得充足资金，用于偿付到期债务、满足计划份额持有人赎回需求、履行其他支付义务和满足正常业务开展的其他资金需求的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于份额持有人于约定开放日要求赎回本集合计划，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。

流动性风险的管理目标是建立科学完善的流动性风险管理体系，对流动性风险进行有效识别、计量、监测和控制，确保流动性需求能够及时以合理成本得到满足。针对兑付赎回资金的流动性风险，本集合计划管理人每日对本集合计划的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划管理人在集合计划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，有效保障集合计划持有人利益。

于 2024 年 6 月 30 日，本集合计划中的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划管理人在集合计划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》等法规的要求对本集合计划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集合计划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。

本集合计划投资于一家公司发行的证券市值不超过集合计划资产净值的 10%，且本集合计划与由本集合计划的管理人管理的其他集合计划共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本集合计划与由本集合计划的管理人管理的其他开放式集合计划共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本集合计划与由本集合计划的管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式集合计划及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本集合计划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，于 2024 年 6 月 30 日，本集合计划未持有流动性受限资产。此外，本集合计划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，其上限一般不超过集合计划持有的债券投资的公允价值。本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过集合计划资产净值的 15%。

集合计划管理人每日对集合计划组合资产中 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。

同时，本集合计划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集合计划从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本集合计划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集合计划合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划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。

##### 6.4.13.4.1 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。

本集合计划管理人定期对本集合计划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。

本集合计划持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本集合计划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。本集合计划持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	85,953,251.92	-	-	-	85,953,251.92
结算备付金	584,071.10	-	-	-	584,071.10
存出保证金	176,064.33	-	-	-	176,064.33
交易性金融资产	-	-	-	-769,083,791.60	769,083,791.60
应收申购款	-	-	-	12,094.72	12,094.72
应收清算款	-	-	-	3,003,200.61	3,003,200.61
资产总计	86,713,387.35	-	-	-772,099,086.93	858,812,474.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	720,871.33	720,871.33
应付管理人报酬	-	-	-	885,078.69	885,078.69
应付托管费	-	-	-	162,264.42	162,264.42
应付清算款	-	-	-	550,129.23	550,129.23
应付销售服务费	-	-	-	3,135,639.95	3,135,639.95
其他负债	-	-	-	1,068,700.38	1,068,700.38
负债总计	-	-	-	6,522,684.00	6,522,684.00
利率敏感度缺口	86,713,387.35	-	-	-765,576,402.93	852,289,790.28
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	87,735,169.33	-	-	-	87,735,169.33
结算备付金	326,767.18	-	-	-	326,767.18
存出保证金	174,660.06	-	-	-	174,660.06
交易性金融资产	-	-	-	1,029,363,123.23	1,029,363,123.23
资产总计	88,236,596.57	-	-	1,029,363,123.23	1,117,599,719.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,633,789.62	1,633,789.62
应付管理人报酬	-	-	-	1,121,452.09	1,121,452.09

应付托管费	-	-	-	205,599.56	205,599.56
应付清算款	-	-	-	12,665,751.24	12,665,751.24
应付销售服务费	-	-	-	3,494,326.16	3,494,326.16
其他负债	-	-	-	456,611.53	456,611.53
负债总计	-	-	-	19,577,530.20	19,577,530.20
利率敏感度缺口	88,236,596.57	-	-	1,009,785,593.03	1,098,022,189.60

注：表中所示为本集合计划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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：截至 2024 年 6 月 30 日，本集合计划未持有债券投资、同业存单投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本集合计划资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本集合计划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、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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	769,083,791.60	90.24	1,029,363,123.23	93.75

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	769,083,791.60	90.24	1,029,363,123.23	93.75

#### 6.4.13.4.3.2 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	72,156,465.03	66,090,913.33
	业绩比较基准下降5%	-72,156,465.03	-66,090,913.33

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	769,083,791.60	1,029,227,587.87
第二层次	-	-
第三层次	-	135,535.36
合计	769,083,791.60	1,029,363,123.23

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 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银行存款、结算备付金、存出保证金，应收清算款、应收申购款、应付清算款和应付赎回款，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 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集合计划不存在需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	769,083,791.60	89.55
	其中：股票	769,083,791.60	89.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	86,537,323.02	10.08
8	其他各项资产	3,191,359.66	0.37
9	合计	858,812,474.28	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	200,476,949.71	23.52
B	采矿业	458,131.00	0.05
C	制造业	526,580,733.95	61.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,658.40	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	706,992.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	343,468.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,050,479.02	1.30
J	金融业	877,015.00	0.10
K	房地产业	7,861,392.00	0.92
L	租赁和商务服务业	16,983,460.00	1.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,873,560.52	0.34

0	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	868,952.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	769,083,791.60	90.24

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末无港股通投资股票。

### 7.3 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	300498	温氏股份	3,788,441	75,086,900.62	8.81
2	002714	牧原股份	1,397,332	60,923,675.20	7.15
3	601966	玲珑轮胎	2,913,700	53,524,669.00	6.28
4	301108	洁雅股份	1,926,545	46,834,308.95	5.50
5	002567	唐人神	7,719,642	41,377,281.12	4.85
6	000636	风华高科	2,990,928	39,061,519.68	4.58
7	603288	海天味业	1,110,949	38,294,412.03	4.49
8	603986	兆易创新	397,330	37,992,694.60	4.46
9	000876	新希望	4,064,478	37,149,328.92	4.36
10	002568	百润股份	2,080,100	35,008,083.00	4.11
11	600745	闻泰科技	1,011,488	28,574,536.00	3.35
12	002458	益生股份	3,286,983	28,465,272.78	3.34
13	002407	多氟多	2,026,242	24,780,939.66	2.91
14	002709	天赐材料	1,164,600	20,450,376.00	2.40
15	600195	中牧股份	2,284,800	17,113,152.00	2.01
16	002127	南极电商	6,532,100	16,983,460.00	1.99
17	002124	ST天邦	6,510,756	13,607,480.04	1.60
18	300408	三环集团	433,347	12,649,398.93	1.48
19	301322	绿通科技	646,356	12,132,102.12	1.42
20	600872	中炬高新	528,203	11,984,926.07	1.41
21	002234	民和股份	1,228,500	11,646,180.00	1.37
22	300568	星源材质	1,388,792	11,388,094.40	1.34
23	300967	晓鸣股份	1,184,501	10,743,424.07	1.26
24	002100	天康生物	1,276,500	8,846,145.00	1.04
25	001215	千味央厨	292,398	8,266,091.46	0.97
26	300682	朗新集团	958,930	8,160,494.30	0.96
27	000002	万科A	1,134,400	7,861,392.00	0.92
28	002812	恩捷股份	248,300	7,858,695.00	0.92
29	000935	四川双马	454,032	5,452,924.32	0.64
30	002548	金新农	1,282,200	5,205,732.00	0.61

31	603833	欧派家居	76,043	4,072,863.08	0.48
32	002597	金禾实业	152,000	3,023,280.00	0.35
33	688330	宏力达	114,401	2,332,636.39	0.27
34	688057	金达莱	211,932	2,079,052.92	0.24
35	688739	成大生物	85,665	2,076,519.60	0.24
36	301287	康力源	74,200	1,977,430.00	0.23
37	688232	新点软件	86,058	1,697,063.76	0.20
38	301525	儒竞科技	28,400	1,598,352.00	0.19
39	688037	芯源微	16,637	1,480,693.00	0.17
40	301310	鑫宏业	51,883	1,250,380.30	0.15
41	603275	众辰科技	40,860	1,225,800.00	0.14
42	688657	浩辰软件	32,276	1,192,920.96	0.14
43	001225	和泰机电	41,100	1,138,881.00	0.13
44	605336	帅丰电器	92,781	1,045,641.87	0.12
45	301456	盘古智能	35,000	913,150.00	0.11
46	601288	农业银行	200,700	875,052.00	0.10
47	300860	锋尚文化	41,300	868,952.00	0.10
48	688485	九州一轨	101,497	791,676.60	0.09
49	600859	王府井	59,800	702,052.00	0.08
50	601857	中国石油	42,200	435,504.00	0.05
51	002352	顺丰控股	9,500	339,055.00	0.04
52	688772	珠海冠宇	11,768	175,343.20	0.02
53	603222	济民医疗	8,161	44,885.50	0.01
54	301550	斯菱股份	809	38,759.19	0.00
55	002371	北方华创	100	31,989.00	0.00
56	688076	诺泰生物	400	31,312.00	0.00
57	002594	比亚迪	100	25,025.00	0.00
58	300308	中际旭创	140	19,303.20	0.00
59	601088	中国神华	300	13,311.00	0.00
60	300502	新易盛	100	10,555.00	0.00
61	301393	昊帆生物	218	9,258.46	0.00
62	600887	伊利股份	200	5,168.00	0.00
63	300049	福瑞股份	100	5,034.00	0.00
64	600585	海螺水泥	200	4,718.00	0.00
65	300976	达瑞电子	100	4,585.00	0.00
66	688573	信宇人	195	4,169.10	0.00
67	688603	天承科技	77	4,020.17	0.00
68	301418	协昌科技	100	4,000.00	0.00
69	002938	鹏鼎控股	100	3,976.00	0.00
70	000651	格力电器	100	3,922.00	0.00
71	301232	飞沃科技	140	3,810.80	0.00
72	002281	光迅科技	100	3,737.00	0.00
73	601899	紫金矿业	200	3,514.00	0.00

74	001367	海森药业	148	3,454.32	0.00
75	301362	民爆光电	100	3,406.00	0.00
76	301087	可孚医疗	100	3,390.00	0.00
77	600938	中国海油	100	3,300.00	0.00
78	301303	真兰仪表	280	3,225.60	0.00
79	301323	新莱福	100	3,158.00	0.00
80	001311	多利科技	130	3,143.40	0.00
81	688671	碧兴物联	144	2,985.12	0.00
82	603477	巨星农牧	100	2,870.00	0.00
83	601006	大秦铁路	400	2,864.00	0.00
84	301203	国泰环保	100	2,831.00	0.00
85	601138	工业富联	100	2,740.00	0.00
86	300174	元力股份	200	2,730.00	0.00
87	301166	优宁维	100	2,700.00	0.00
88	301446	福事特	130	2,515.50	0.00
89	301353	普莱得	100	2,509.00	0.00
90	600160	巨化股份	100	2,413.00	0.00
91	000049	德赛电池	100	2,345.00	0.00
92	301468	博盈特焊	100	2,313.00	0.00
93	301088	戎美股份	200	2,240.00	0.00
94	605177	东亚药业	100	2,207.00	0.00
95	300868	杰美特	100	2,095.00	0.00
96	300438	鹏辉能源	100	1,834.00	0.00
97	688531	日联科技	39	1,800.24	0.00
98	688623	二元科技	32	1,799.36	0.00
99	688450	光格科技	72	1,752.48	0.00
100	688581	安杰思	35	1,712.55	0.00
101	601001	晋控煤业	100	1,652.00	0.00
102	003023	彩虹集团	100	1,595.00	0.00
103	001210	金房能源	120	1,592.40	0.00
104	601919	中远海控	100	1,549.00	0.00
105	301429	森泰股份	100	1,530.00	0.00
106	001218	丽臣实业	100	1,497.00	0.00
107	301559	中集环科	100	1,457.00	0.00
108	603663	三祥新材	100	1,439.00	0.00
109	688230	芯导科技	35	1,269.10	0.00
110	300970	华绿生物	100	1,147.00	0.00
111	688317	之江生物	74	1,066.34	0.00
112	601985	中国核电	100	1,066.00	0.00
113	601009	南京银行	100	1,039.00	0.00
114	688638	誉辰智能	31	967.51	0.00
115	601988	中国银行	200	924.00	0.00
116	603993	洛阳钼业	100	850.00	0.00

117	688363	华熙生物	11	622.27	0.00
118	688646	逸飞激光	14	436.94	0.00
119	688286	敏芯股份	8	380.80	0.00
120	688610	埃科光电	10	336.30	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入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	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002568	百润股份	51,169,969.00	4.66
2	600048	保利发展	26,053,408.00	2.37
3	301108	洁雅股份	23,529,007.32	2.14
4	601966	玲珑轮胎	22,460,933.00	2.05
5	002821	凯莱英	21,839,198.20	1.99
6	002127	南极电商	21,709,220.00	1.98
7	600195	中牧股份	20,149,560.00	1.84
8	600872	中炬高新	19,436,445.20	1.77
9	002271	东方雨虹	19,213,684.00	1.75
10	002709	天赐材料	16,082,792.05	1.46
11	301322	绿通科技	15,075,189.25	1.37
12	603288	海天味业	14,434,979.91	1.31
13	300750	宁德时代	12,692,364.00	1.16
14	002567	唐人神	12,634,686.00	1.15
15	300682	朗新集团	11,196,403.50	1.02
16	001215	千味央厨	10,644,147.22	0.97
17	600585	海螺水泥	10,614,203.00	0.97
18	002548	金新农	9,772,892.00	0.89
19	000002	万科 A	9,374,504.00	0.85
20	600887	伊利股份	9,242,144.44	0.84

##### 7.4.2 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	600048	保利发展	53,913,465.00	4.91
2	002271	东方雨虹	43,829,453.97	3.99
3	300408	三环集团	43,503,774.41	3.96
4	002212	天融信	41,787,506.50	3.81
5	300223	北京君正	27,082,859.20	2.47
6	000651	格力电器	27,049,407.06	2.46
7	300271	华宇软件	24,440,698.60	2.23
8	002821	凯莱英	23,027,896.80	2.10

9	000935	四川双马	21,586,609.98	1.97
10	002714	牧原股份	16,639,830.00	1.52
11	300498	温氏股份	15,373,280.00	1.40
12	002511	中顺洁柔	14,176,000.52	1.29
13	300750	宁德时代	12,079,797.00	1.10
14	300568	星源材质	11,418,069.25	1.04
15	600585	海螺水泥	11,030,469.00	1.00
16	603288	海天味业	10,068,294.80	0.92
17	600383	金地集团	10,010,048.00	0.91
18	300761	立华股份	9,879,705.60	0.90
19	600887	伊利股份	9,480,745.00	0.86
20	300438	鹏辉能源	8,640,719.88	0.79

#### 7.4.3 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	532,406,161.10
卖出股票收入（成交）总额	609,865,610.63

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末无债券投资。

#### 7.6 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

注：本基金本报告期末无债券投资。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末无资产支持证券投资。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末无贵金属投资。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末无权证投资。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

无。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

否。

#### 7.12.3 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	176,064.33
2	应收清算款	3,003,200.61
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,094.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,191,359.66

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。



## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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 (%)
中信建投价值增长 A	20,830	39,635.31	27,613,813.49	3.34	797,989,631.77	96.66
中信建投价值增长 C	5,834	24,192.85	1,098,296.74	0.78	140,042,782.88	99.22
合计	26,664	36,256.55	28,712,110.23	2.97	938,032,414.65	97.03

注：1. 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）；

2. “户均持有的基金份额”的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 8.2 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	中信建投价值增长 A	5,216,334.39	0.6318
	中信建投价值增长 C	1,982,214.03	1.4044
	合计	7,198,548.42	0.7446

注：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）。

### 8.3 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	中信建投价值增长 A	>100
	中信建投价值增长 C	0~10

	合计	>100
本基金基金经理持有 本开放式基金	中信建投价值增长 A	0
	中信建投价值增长 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信建投价值增长 A	中信建投价值增长 C
基金合同生效日 (2020 年 12 月 7 日) 基金份额总额	56,671,909.42	-
本报告期期初基金 份额总额	879,731,603.54	152,546,888.03
本报告期基金总申 购份额	2,602,590.13	518,300.54
减：本报告期基金总 赎回份额	56,730,748.41	11,924,108.95
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	825,603,445.26	141,141,079.62

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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执行委员会委员周志钢因达到法定退休年龄离任。基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	中信建投证券股份有限公司及相关人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 1 月 3 日
采取稽查或处罚等措施的机构	深交所
受到的具体措施类型	书面警示
受到稽查或处罚等措施的原因	2024 年 1 月 3 日，深交所出具《关于对中信建投证券股份有限公司、汪浩吉、方英健的监管函》（深证函〔2024〕11 号），指出公司作为保荐人，汪浩吉、方英健作为保荐代表人，在保荐芯天下技术股份有限公司首次公开发行股票并在创业板上市的过程中，存在以下违规行为：未对发行人所处市场情况及同行业可比公司情况予以充分关注，未充分核查发行人对终端客户的销售情况，对发行人业绩预计情况未审慎发表专业意见并督促发行人提高信息披露质量。上述行为违反了《深圳证券交易所创业板股票发行上市审核规则》第三十条、第四十二条的规定。深交所决定对公司、汪浩吉、方英健采取书面警示的自律监管措施。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	针对该处罚，公司整改措施如下：公司积极落实整改，通过发布业务提醒、持续开展培训、加强行业学习和交流等方式，

	提升从业人员投行执业能力,进一步夯实业务人员的履职意识,提高质控、内核等岗位人员的风控意识。
其他	无
<b>措施 2</b>	<b>内容</b>
受到稽查或处罚等措施的主体	中信建投证券股份有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 1 月 24 日
采取稽查或处罚等措施的机构	山东证监局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	2024 年 1 月 24 日,山东证监局出具《关于对中信建投证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》((2024)13 号),指出公司存在持续督导不规范问题:2022 年 9 月 8 日,云鼎科技股份有限公司通过非公开发行股票募集资金人民币 8.68 亿元。2022 年 10 月 28 日,募集资金由募集资金专户转出,用于补充流动资金和偿还债务。山东证监局发现发行人存在相关制度不健全、使用不规范的情形。作为保荐机构,公司未能勤勉尽责、持续督导发行人完善制度、采取措施规范募集资金补充流动资金和偿还债务使用过程。上述情形违反了《上市公司监管指引第 2 号-上市公司募集资金管理和使用的监管要求》第十四条、《证券发行上市保荐业务管理办法》第十六条规定,山东证监局决定对公司采取出具警示函的监管措施,同时将相关情况记入证券期货市场诚信档案数据库。上述处罚中所涉行为,同时还违反《深圳证券交易所股票上市规则》第 1.4 条、第 12.1.2 条和《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 13 号——保荐业务》第三条第一款的规定,深交所于 2024 年 7 月 3 日对公司采取书面警示的自律监管措施。
管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	针对上述处罚,公司整改措施如下:公司积极落实整改,通过组织工作人员深入学习相关法规、加强对发行人相关人员的持续督导培训、进一步加强对发行人募集资金使用情况的现场检查力度等方式,提高发行人规范使用募集资金的意识以及公司持续督导责任意识。
其他	无
<b>措施 3</b>	<b>内容</b>
受到稽查或处罚等措施的主体	中信建投证券股份有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 24 日
采取稽查或处罚等措施的机构	广东证监局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	2024 年 4 月 24 日,广东证监局出具《关于对中信建投证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》((2024)35 号),指出公司作为格力地产股份有限公司债券“23 格地 01”的主承销商和受托管理人,咨询审计机构工作底稿留痕不足,未对发行人管理层制作访谈记录,未对发行人重大损失披露临时受托管理事务报告,不符合《公司债券承销业务尽职调查指引(2020 年)》第十一条、第二十一条,《公司债券受

	托管理人执业行为准则（2022 年）》第十二条、第十八条等要求，违反了《公司债券发行与交易管理办法》第六条第一款的规定。广东证监局决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。前述行为同时还违反《上海证券交易所非公开发行公司债券挂牌规则（2022 年修订）》的相关规定，上交所于 2024 年 5 月 28 日对公司采取书面警示的监管措施。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	针对该处罚，公司整改措施如下：公司积极落实整改，持续组织债券高质量执业系列培训，发布合规业务提示，梳理并细化受托管理执业要求，加强对日常执业质量评价，完善考核机制，加大内部追责，进一步提升业务人员债券执业水平和公司债券业务执业质量。
其他	无
<b>措施 4</b>	<b>内容</b>
受到稽查或处罚等措施的主体	中信建投证券股份有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 30 日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	责令增加合规检查次数
受到稽查或处罚等措施的原因	2024 年 4 月 30 日，北京证监局出具《关于对中信建投证券股份有限公司采取责令增加合规检查次数的行政监管措施的决定》（〔2024〕99 号），指出公司存在以下问题：开展场外期权及自营业务不审慎，对从业人员管理不到位，公司治理不规范，反映出公司未能有效实施合规管理、风险管理和内部控制，违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条第一款、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法（2020 年修订）》第三条的规定。北京证监局决定对公司采取如下监管措施：责令公司就上述问题认真整改，并在监管措施决定下发之日起一年内，每 3 个月开展一次内部合规检查，根据检查情况不断完善管理制度和内部控制措施，加强对业务和人员管理，防范和控制风险，并在每次检查后 10 个工作日内向北京证监局报送合规检查报告。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	针对该处罚，公司整改措施如下：公司积极落实整改，修订场外期权及自营业务制度流程，加强从业人员管理，强化合规培训，持续完善公司内部治理，从严落实合规、风险管理和内部控制要求，并按照要求增加内部合规检查次数。
其他	无
<b>措施 5</b>	<b>内容</b>
受到稽查或处罚等措施的主体	中信建投证券股份有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 5 月 14 日
采取稽查或处罚等措施的机构	上交所
受到的具体措施类型	监管警示
受到稽查或处罚等措施的原因	2024 年 5 月 14 日，上交所出具《关于对中信建投证券股份有限公司予以监管警示的决定》（〔2024〕26 号），指出公司作为深圳中兴新材技术股份有限公司首次公开发行股票并在科创板上市申请项目的保荐人，在相关项目的保荐工作

	中，存在以下保荐职责履行不到位的情形：对发行人废膜管理相关内部控制缺陷整改及运行情况的核查工作明显不到位；对发行人研发费用的核查工作明显不到位。上述行为违反了《上海证券交易所股票发行上市审核规则》第十五条、第二十七条等有关规定。上交所决定对公司采取监管警示的监管措施。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	针对该处罚，公司整改措施如下：公司积极落实整改，通过开展风险警示教育与业务能力提升培训、细化完善业务要求等方式，进一步夯实业务人员的履职意识，提高质控、内核等岗位人员的风控意识。
其他	无
<b>措施 6</b>	<b>内容</b>
受到稽查或处罚等措施的主体	中信建投证券股份有限公司及相关人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 5 月 17 日
采取稽查或处罚等措施的机构	江苏证监局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	2024 年 5 月 17 日，江苏证监局出具《江苏证监局关于对中信建投证券股份有限公司及张铁、张悦采取出具警示函措施的决定》（〔2024〕91 号），指出江苏常熟汽饰集团股份有限公司（以下简称常熟汽饰）2019 年公开发行可转换公司债券募集资金 9.92 亿元。按照项目立项时间和募集资金投资项目原定规划建设期，上饶项目、常熟项目、余姚项目分别应于 2020 年 1 月、2020 年 1 月和 2020 年 7 月完成建设，但上述项目均未如期完成建设。常熟汽饰未在历次募集资金存放和实际使用情况的专项报告中披露上述项目实施进度未达计划进度的情况，风险提示不充分，信息披露不真实。公司作为保荐机构，未能勤勉尽责履行持续督导义务，未发现上述问题，且在历次关于常熟汽饰募集资金实际使用情况的专项核查报告中发表了不真实的核查意见。公司上述行为违反了《证券发行上市保荐业务管理办法》、《证券发行上市保荐业务管理办法》、《上市公司信息披露管理办法》等制度的相关规定。张铁、张悦作为持续督导工作的签字保荐代表人，是上述违规行为的直接责任人员。江苏证监局决定对公司及张铁、张悦采取出具警示函的监管措施，并记入证券期货市场诚信档案。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	针对该处罚，公司整改措施如下：公司积极落实整改，责令相关人员反思学习、提高执业谨慎度，全面梳理发行人募集资金使用情况，督促发行人自查整改，增强持续督导工作力度，持续督促常熟汽饰完善信息披露，进一步强化公司内部培训学习，提升合规、责任和风险意识。
其他	无
<b>措施 7</b>	<b>内容</b>
受到稽查或处罚等措施的主体	中信建投证券股份有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 6 月 19 日

采取稽查或处罚等措施的机构	上交所
受到的具体措施类型	监管警示
受到稽查或处罚等措施的原因	2024 年 6 月 19 日，上交所出具《关于对中信建投证券股份有限公司予以监管警示的决定》（〔2024〕36 号），指出上所在审核大参林医药集团股份有限公司向特定对象发行股票的申请过程中，发行人申请撤回申报材料，上交所于 2024 年 1 月 31 日作出终止审核决定。公司作为项目的保荐人，存在以下保荐职责履行不到位的情形：茂名大参林连锁药店有限公司（以下简称茂名子公司）为发行人全资子公司，柯金龙为发行人实际控制人之一兼时任董事（任职期间为 2016 年 8 月 18 日至 2024 年 2 月 9 日）。2023 年 8 月 18 日，茂名子公司收到广东省茂名市监察委员会下发的《立案通知书》，载明茂名子公司受到立案调查；2023 年 8 月 24 日，收到广东省茂名市公安局电白分局下发的《拘留通知书》，载明柯金龙受到刑事拘留；2023 年 11 月 23 日，收到广东省茂名市电白区人民检察院《起诉书》，载明茂名子公司、柯金龙因涉嫌单位行贿罪被依法提起公诉。上述事项发生后，保荐人未按规定及时向上交所报告并申请审核中止，直至 2024 年 3 月 14 日，发行人告知保荐人，保荐人才向上交所报告上述事项。保荐人在项目保荐期间未能勤勉尽责，未能及时发现并向上交所报告相关事项。上述行为违反了《上海证券交易所上市公司证券发行上市审核规则》第十七条、第十九条及《上海证券交易所股票发行上市审核规则》第五十四条、第六十条等有关规定。上交所决定对公司采取监管警示的监管措施。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	针对该处罚，公司整改措施如下：公司积极落实整改，通过进一步完善核查程序、持续开展业务培训、发布合规提醒等方式，提升从业人员执业能力和敏锐度，进一步提高保荐工作质量。
其他	无

注：本报告期内管理人积极按要求整改受稽查或处罚等事项。但相关受稽查或处罚的事项与管理人资产管理业务及管理的资产管理计划无关。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	



			(%)		(%)	
中信建投证券股份有限公司	2	1,142,271,771.73	100.00	912,836.29	100.00	-

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序：

- (1) 经营行为规范；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用本管理人的交易单元。

3. 报告期内本基金未变更交易单元。

### 10.7.2 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	
	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(%)
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

注：无。

### 10.8 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	中信建投价值增长混合型集合资产管理计划恢复申购、定期定额投资公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年1月15日
2	中信建投证券股份有限公司旗下基金2023年第4季度报告提示性公告	中国证券报	2024年1月22日
3	中信建投价值增长混合型集合资产管理计划2023年第4季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年1月22日
4	中信建投价值增长混合型集合资产管理计划基金经理变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年1月29日

5	中信建投价值增长混合型集合资产管理计划（C 类份额）产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 31 日
6	中信建投价值增长混合型集合资产管理计划（A 类份额）产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 31 日
7	中信建投价值增长混合型集合资产管理计划更新招募说明书	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 31 日
8	关于中信建投价值增长混合型集合资产管理计划增加上海好买基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 2 月 26 日
9	中信建投证券股份有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证券报	2024 年 3 月 29 日
10	中信建投价值增长混合型集合资产管理计划 2023 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 29 日
11	中信建投证券股份有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2024 年 4 月 23 日
12	中信建投价值增长混合型集合资产管理计划 2024 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 23 日
13	关于中信建投价值增长混合型集合资产管理计划增加和耕传承基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 29 日
14	中信建投证券股份有限公司关于董事变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 5 月 7 日
15	关于中信建投价值增长混合型集合资产管理计划增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 5 月 8 日
16	中信建投证券股份有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 5 月 25 日
17	关于中信建投价值增长混合型集合资产管理计划增加北京雪球基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 6 日
18	中信建投价值增长混合型集合资产管理计划（中信建投价值增长 A 份额）产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 28 日
19	中信建投价值增长混合型集合资产管理计划（中信建投价值增长 C 份额）产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 28 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、证监会关于准予中信建投精彩理财灵活配置集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《中信建投价值增长混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《中信建投价值增长混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《中信建投价值增长混合型集合资产管理计划招募说明书》；
- 5、定期报告，包括季度报告、中期报告和年度报告；
- 6、管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在集合计划管理人、集合计划托管人所在地，供公众查阅。

### 12.3 查阅方式

- 1、集合计划管理人互联网站：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)
- 2、集合计划管理人或集合计划托管人的办公场所
- 3、中国证监会基金电子披露网站：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>

中信建投证券股份有限公司

2024 年 8 月 30 日