

中信证券成长动力混合型集合资产管理计划

2021 年中期报告

2021 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：二〇二一年八月三十日

§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基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标	4
3.2 基金净值表现	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	10
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	13
§7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	40
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	40
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	40
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	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	41
§8 基金份额持有人信息.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	43
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	44
§12 备查文件目录.....	44

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信证券成长动力混合型集合资产管理计划	
基金简称	中信证券成长动力	
基金主代码	900009	
交易代码	900009	
基金运作方式	契约开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 25 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	
报告期末基金份额总额	385,482,880.68 份	
下属分级基金的基金简称	中信证券成长动力 A	中信证券成长动力 C
下属分级基金的交易代码	900009	900059
报告期末下属分级基金的份额总额	308,707,799.95 份	76,775,080.73 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。

2.2 基金产品说明

投资目标	通过重点投资具备持续成长动力的 A 股、港股通标的中的优质股票，追求集合计划中长期内获得稳健回报。
投资策略	本集合计划首先参考管理人投资决策委员会所形成的大类资产配置范围，管理人投资决策委员会主要采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，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。
业绩比较基准	65%*沪深 300 指数收益率+10%*恒生指数收益率+25%*中债综合财富指数收益率
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。

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	梁源	姜敏
	联系电话	95548	4006800000
	电子邮箱	liangyuan@citics.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		95548	95558
传真		(010) 60836627	010-85230024
注册地址		广东省深圳市福田区中心三路	北京市朝阳区光华路10号院1号楼

	8号卓越时代广场（二期）北座	6-30层、32-42层
办公地址	北京朝阳区亮马桥路48号中信 证券大厦16层	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	100026	100020
法定代表人	张佑君	李庆萍

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	http://www.cs.ecitic.com
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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）	
	中信证券成长动力 A	中信证券成长动力 C
本期已实现收益	36,537,530.88	-1,830,437.92
本期利润	19,431,255.82	10,963,720.60
加权平均基金份额本期利润	0.0700	0.1531
本期加权平均净值利润率	3.01%	6.72%
本期基金份额净值增长率	-0.62%	-0.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	中信证券成长动力 A	中信证券成长动力 C
期末可供分配利润	418,511,529.94	103,368,241.96
期末可供分配基金份额利润	1.3557	1.3464
期末基金资产净值	727,219,329.89	180,143,322.69
期末基金份额净值	2.3557	2.3464
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	中信证券成长动力 A	中信证券成长动力 C
基金份额累计净值增长率	5.08%	4.66%

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。

3.2 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

中信证券成长动力 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	0.00%	0.90%	-1.36%	0.57%	1.36%	0.33%
过去三个月	4.11%	0.88%	2.79%	0.69%	1.32%	0.19%
过去六个月	-0.62%	1.38%	1.50%	0.93%	-2.12%	0.45%
自基金合同生效起至今	5.08%	1.32%	5.16%	0.89%	-0.08%	0.43%

中信证券成长动力 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	-0.07%	0.90%	-1.36%	0.57%	1.29%	0.33%
过去三个月	3.90%	0.88%	2.79%	0.69%	1.11%	0.19%
过去六个月	-0.97%	1.38%	1.50%	0.93%	-2.47%	0.45%
自基金合同生效起至今	4.66%	1.32%	5.16%	0.89%	-0.50%	0.43%

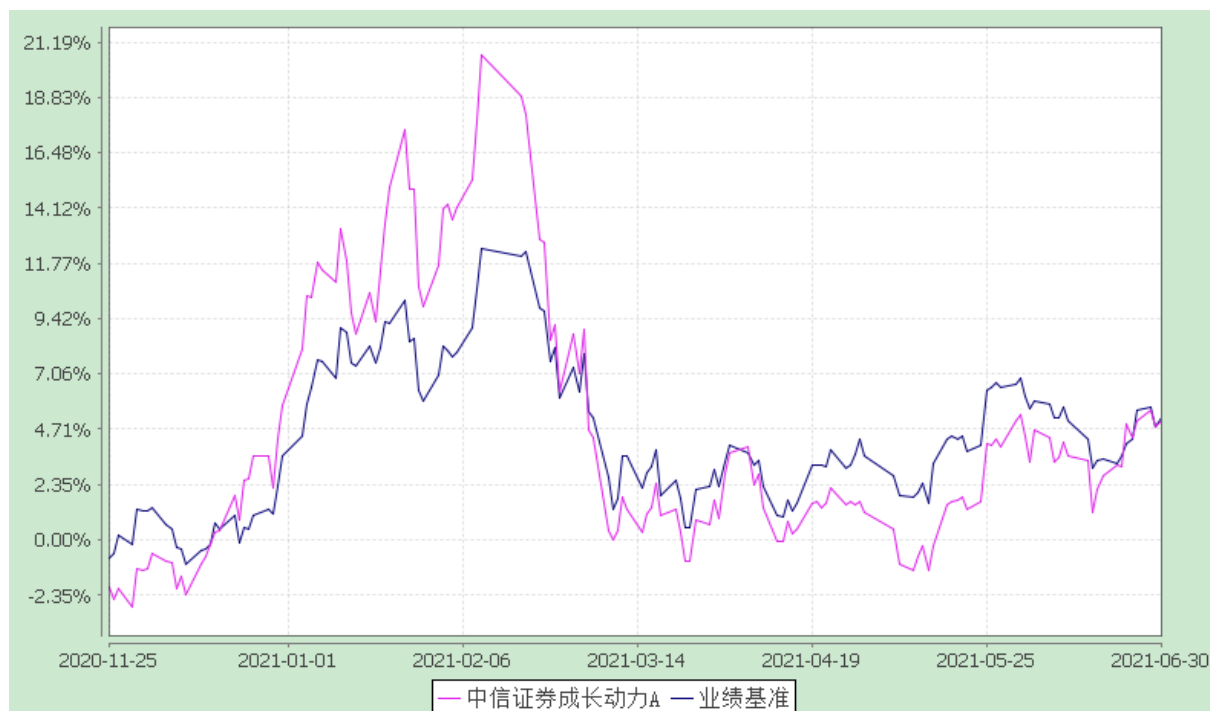
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中信证券成长动力混合型集合资产管理计划

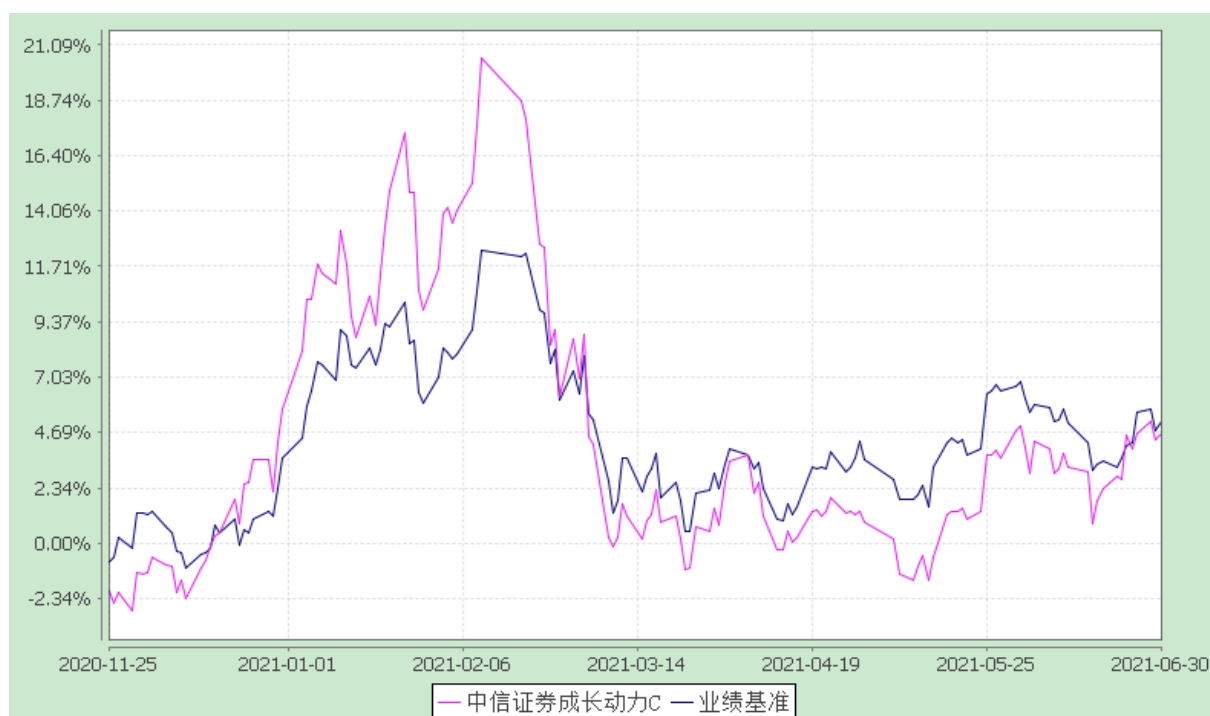
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 11 月 25 日至 2021 年 6 月 30 日)

中信证券成长动力 A



中信证券成长动力 C



§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

中信证券股份有限公司(以下简称“中信证券”或“公司”)于 1995 年 10 月 25 日在北京成立。2002 年 12 月 13 日,经中国证券监督管理委员会核准,中信证券向社会公开发行 4 亿股普通 A 股股票,2003 年 1 月 6 日在上海证券交易所挂牌上市交易,股票简称“中信证券”,股票代码“600030”。2011 年 10 月 6 日在香港联合交易所上市交易,股票代码为“6030”。

中信证券自 1998 年开始经营资产管理业务,有 20 余年丰富的投资管理经验。业内唯一一家同时具有企业年金投资管理人、社保基金境内投资管理人和社保基金转持股份管理资格、保险资金受托投资管理资格、基本养老保险基金投资管理人资格的券商。

中信证券根据《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,截至 2021 年 6 月 30 日,旗下已有 11 只大集合产品完成公募化改造,分别为“中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划”、“中信证券红利价值一年持有混合型集合资产管理计划”、“中信证券臻选价值成长混合型集合资产管理计划”、“中信证券量化优选股票型集合资产管理计划”、“中信证券卓越成长两年持有期混合型集合资产管理计划”、“中信证券稳健回报混合型集合资产管理计划”、“中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划”、“中信证券成长动力混合型集合资产管理计划”、“中信证券增益十八个月持有期债券型集合资产管理计划”、“中信证券信远一年持有期混合型集合资产管理计划”、“中信证券债券优化一年持有期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		
李品科	本基金的基金经理	2020-11-25	-	12	清华大学硕士,13 年投研从业经验。2016 年加入中信证券资产管理部,任中信证券资产管理业务总监、投资经理。长期从事股票研究和投资,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“离任日期”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。

4.1.3 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

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
李品科	公募基金	2	994,910,679.83	2020 年 11 月 25 日
	私募资产管理计划	1	57,361,065.83	2018 年 03 月 30 日
	其他组合	-	-	-
	合计	3	1,052,271,745.66	

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合规守信情况的说明

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 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 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

2021 年上半年，沪深 300 上涨 0.24%，上证指数上涨 3.4%，创业板指数上涨 17.22%；港股市场相对偏弱，恒生指数上涨 5.86%，恒生中国企业指数下跌 0.7%。行业持续分化，新能源车、光伏、钢铁、有色、煤炭、医药、汽车等涨幅居前，非银、家电、房地产、农业、军工、通信、传媒等行业下跌。港股互联网、教育等行业大幅下跌，主要受到政策监管加强的压力。

今年年初快速上涨，但是春节后流动性收缩，市场对货币政策收紧的担忧引发高估值板块的调整。二季度在一季度的大幅下跌后，由于国内政府政策的维稳导向，投资风险偏好明显提升，以创业板为首的市场迎来反弹。整个市场来看，以光伏、新能源车、半导体为代表的高端制造业，受

到政策的持续鼓励，叠加市场对其中长期预期的乐观，持仓度持续加大。而消费板块，主要是由于去年疫情原因导致的高基数，上半年消费的基本面整体偏弱。

本集合计划，上半年募集后处于建仓期，在行业上主要增加了新能源、消费、电子、汽车等配置。仓位由于 2 季度处于建仓期，保持相对平稳的建仓周期。个股方面，依然坚持 GARP 策略，自上而下和自下而上相结合，选择景气度较好、估值合理、符合预期收益率的优质个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，中信证券成长动力 A 基金份额净值为 2.3557 元，本报告期份额净值增长率为-0.62%；中信证券成长动力 C 基金份额净值为 2.3464 元，本报告期份额净值增长率为-0.97%，同期业绩比较基准增长率为 1.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，货币政策、财政政策趋向于边际宽松，对股市形成助力。上证指数在 3400 点附近，整个市场仍处在合理位置，整体没有明显泡沫。下半年 CPI 上行压力整体不大，对货币政策构不成压力。今年市场的结构性机会仍较多。新能源包括光伏风电，基本面明年仍有明显改善趋势，部分优质个股格局较好、估值合理，仍可以享受行业快速增长的红利；新能源汽车行业景气度高，长期成长趋势明显，其中部分二线公司技术快速追赶，估值仍处于合理区间，同时相关产业链上部分公司长期受益于新能源车的持续放量，业务上增量受益明显，在合理估值范围内可以持续配置；消费股中部分较高成长的优质个股持续下跌，目前已到了较好的买入位置，会逐步配置。

从策略上，降低港股配置比例，由于 A 股流动性好、资金面充裕，相对来说，港股的折价可能持续存在，管理人在港股会优选稀缺的优质标的。A 股，整体配置以光伏、风电，新能源车产业链中偏低估、存在较大弹性的个股，以及 VR、食品饮料、医药为主要配置，优选估值合理的优质持续成长性标的。仓位上，在货币政策趋松的趋势下，账户计划处于较高仓位。

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，建立了估值委员会，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。会计师事务所在估值调整导致集合计划资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内未进行收益分配。

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 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

作为本基金的托管人，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、基金合同和托管协议的规定，对本基金 2021 年的投资运作，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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本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，管理人的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2021 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 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中信证券成长动力混合型集合资产管理计划

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-

银行存款	6.4.7.1	51,691,900.98	4,434,639.71
结算备付金		24,793,018.04	17,465,814.52
存出保证金		2,226.92	273,757.56
交易性金融资产	6.4.7.2	858,230,405.47	344,585,685.34
其中：股票投资		796,488,535.47	326,586,210.33
基金投资		-	-
债券投资		61,741,870.00	17,999,475.01
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		11,351,204.30	-
应收利息	6.4.7.5	955,335.67	205,215.09
应收股利		557,694.18	-
应收申购款		200,603.33	309,359.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		947,782,388.89	367,274,471.82
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负债：		-	-
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		-	-
应付证券清算款		-	10,587,528.82
应付赎回款		36,609,672.71	1,361,336.88
应付管理人报酬		1,198,051.06	425,870.94
应付托管费		199,675.17	70,978.52
应付销售服务费		496,602.59	2.59
应付交易费用	6.4.7.7	-	433,006.41
应交税费		1,704,823.56	2,228,102.98
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	210,911.22	100,887.57
负债合计		40,419,736.31	15,207,714.71
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	385,482,880.68	148,533,327.71
未分配利润	6.4.7.10	521,879,771.90	203,533,429.40
所有者权益合计		907,362,652.58	352,066,757.11
负债和所有者权益总计		947,782,388.89	367,274,471.82

注：1.报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 385,482,880.68 份，其中 A 类基金份额净

值 2.3557 元，基金份额总额 308,707,799.95 份；C 类基金份额净值 2.3464 元，基金份额总额 76,775,080.73 份。

6.2 利润表

会计主体：中信证券成长动力混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		41,787,369.74
1.利息收入		839,263.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	294,371.80
债券利息收入		516,602.63
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		28,289.17
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		43,804,818.36
其中：股票投资收益	6.4.7.12	39,542,418.28
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-337.80
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-
股利收益	6.4.7.18	4,262,737.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-4,312,116.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,455,404.32
减：二、费用		11,392,393.32
1.管理人报酬		5,928,677.04
2.托管费		988,112.82
3.销售服务费		628,375.12
4.交易费用	6.4.7.21	3,608,476.09
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		148,594.85
7. 其他费用	6.4.7.22	90,157.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,394,976.42
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,394,976.42
-------------------	--	---------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信证券成长动力混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	148,533,327.71	203,533,429.40	352,066,757.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,394,976.42	30,394,976.42
三、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）	236,949,552.97	287,951,366.08	524,900,919.05
其中：1.基金申购款	444,059,686.54	559,445,996.47	1,003,505,683.01
2.基金赎回款	-207,110,133.57	-271,494,630.39	-478,604,763.96
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	385,482,880.68	521,879,771.90	907,362,652.58

报表附注为财务报表的组成部分。

基金管理人负责人：杨冰，主管会计工作负责人：杨琳，会计机构负责人：杨琳

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信证券成长动力混合型集合资产管理计划(以下简称“本基金”)是由中信证券股票精选集合资产管理计划转型而来。中信证券成长动力股票集合资产管理计划的管理人中信证券股份有限公司于 2020 年 10 月 12 日发布《中信证券股票精选集合资产管理计划变更征询公告》。根据公告，中信证券股票精选集合资产管理计划名称变更为“中信证券成长动力混合型集合资产管理计划”，中信证券股票精选集合资产管理计划份额转换为中信证券成长动力混合型集合资产管理计划份额。合同变更后，本基金的托管人、登记机构不变。自 2020 年 11 月 25 日起《中信证券成长动力混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《中信证券成长动力混合型集合资产管理计划托管协议》生效。本基金自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本基金的管理人为中信证券股份有限公司(以下简

称“中信证券”), 托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信证券成长动力混合型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行的股票(包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许投资的股票)、港股通标的股票、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、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金的投资组合比例为: 股票投资占基金资产的 50-95%, 其中投资于“成长动力”主题股票的比例不低于基金非现金资产的 80%, 投资于港股通标的股票比例占股票资产的 0-50%。每个交易日日终扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为: $65\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 10\% \times \text{恒生指数收益率} + 25\% \times \text{中债综合财富指数收益率}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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<年度报告和半年度报告>》、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》、《中信证券成长动力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 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年

01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1)对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，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其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)对不存在活跃市场的投资品种，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，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

本基金的份额面值为人民币 1.00 元。实收基金为对外发行基金份额总额。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实收基金增加和转出实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。

损益平准金于申购确认日或赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按资产管理合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类和 C 类基金份额的销售费用收取方式存在不同，各基金份额类别对应的可供分配收益将有所不同。同一类别每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现

金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金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(以下称资管产品运营业务)，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

比照《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》(财税字[1998] 55 号)和《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税[2002]128 号)文件的规定，计划管理人运用资产管理计划买卖股票，卖出股票按 1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	51,691,900.98
定期存款	-
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	-
合计	51,691,900.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	744,341,655.25	796,488,535.47	52,146,880.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	31,686,600.00	31,723,870.00
	银行间市场	29,941,190.00	30,018,000.00
	合计	61,627,790.00	61,741,870.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	805,969,445.25	858,230,405.47	52,260,960.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	8,311.99
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,524.81
应收债券利息	945,497.87
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	1.00
合计	955,335.67

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

无。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	51,403.85
应付证券出借违约金	-
其他	159,507.37
合计	210,911.22

6.4.7.9 实收基金

中信证券成长动力 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	148,524,544.64	148,524,544.64
本期申购	255,226,051.48	255,226,051.48
本期赎回（以“-”号填列）	-95,042,796.17	-95,042,796.17
本期末	308,707,799.95	308,707,799.95

中信证券成长动力 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	8,783.07	8,783.07
本期申购	188,833,635.06	188,833,635.06
本期赎回（以“-”号填列）	-112,067,337.40	-112,067,337.40
本期末	76,775,080.73	76,775,080.73

6.4.7.10 未分配利润

中信证券成长动力 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	183,431,307.84	20,090,093.22	203,521,401.06
本期利润	36,537,530.88	-17,106,275.06	19,431,255.82
本期基金份额交易产生的变动数	241,528,484.99	-45,969,611.93	195,558,873.06
其中：基金申购款	381,529,513.42	-59,636,114.33	321,893,399.09
基金赎回款	-140,001,028.43	13,666,502.40	-126,334,526.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	461,497,323.71	-42,985,793.77	418,511,529.94

中信证券成长动力 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	10,969.91	1,058.43	12,028.34
本期利润	-1,830,437.92	12,794,158.52	10,963,720.60
本期基金份额交易产生的变动数	116,991,818.18	-24,599,325.16	92,392,493.02
其中：基金申购款	284,263,540.64	-46,710,943.26	237,552,597.38
基金赎回款	-167,271,722.46	22,111,618.10	-145,160,104.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	115,172,350.17	-11,804,108.21	103,368,241.96

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	123,054.09
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	170,435.18
其他	882.53
合计	294,371.80

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,050,759,267.48
减：卖出股票成本总额	1,011,216,849.20
买卖股票差价收入	39,542,418.28

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。

6.4.7.13 基金投资收益

无。

6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,066,465.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,021,800.00
减：应收利息总额	45,003.13
买卖债券差价收入	-337.80

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.16 贵金属投资收益

无。

6.4.7.17 衍生工具收益

无。

6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,262,737.88
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	4,262,737.88

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-4,457,527.13
——股票投资	-4,550,732.12
——债券投资	93,204.99
——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、税金及附加	-145,410.59
合计	-4,312,116.54

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	1,455,404.32
合计	1,455,404.32

6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	3,608,101.09
银行间市场交易费用	375.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	3,608,476.09

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	-
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
银行划款费	45.00
其他	12,605.03
合计	90,157.40

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，本基金无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，本基金无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

本基金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
中信证券	基金管理人、基金销售机构
中信银行	基金托管人、基金销售机构
中信证券（山东）有限责任公司	基金管理人的子公司、销售机构
中信证券华南股份有限公司	基金管理人的子公司、销售机构
中信期货有限公司	基金管理人的子公司、销售机构
上海华夏财富投资管理有限公司	基金管理人的子公司、销售机构
中国中信有限公司	基金管理人股东

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 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	2,537,156,782.29	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	17,751,262.20	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

中信证券	379,900,000.00	100.00%
------	----------------	---------

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 2021年1月1日至2021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
中信证券	1,892,717.10	100.00%	-	-

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 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,928,677.04
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付基金管理人中信证券的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	988,112.82

注：支付托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信证券成长动力 A	中信证券成长动力 C	合计
中信证券	-	532,806.63	532,806.63
中信银行	-	911.35	911.35
中信证券华南股份	-	51,821.91	51,821.91

有限公司			
中信证券(山东)有 限责任公司	-	40,906.79	40,906.79
中信期货有限公司	-	1,898.51	1,898.51
合计	-	628,345.19	628,345.19

注：支付销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 0.80% 的年费率计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 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

6.4.10.3.1 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

无。

6.4.10.3.2 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

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	51,691,900.98	123,054.09

注：本基金的银行存款由托管行中信银行保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2021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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受限	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本	期末 估值总额	备注

				类型				总额		
300926	博俊科技	2020-1 2-29	2021-0 7-07	新发 流通 受限	10.76	22.200 0	181.00	1,947. 56	4,018.20	-
300931	通用 电梯	2021-0 1-13	2021-0 7-21	新发 流通 受限	4.31	13.110 0	218.00	939.58	2,857.98	-
300932	三友 联众	2021-0 1-15	2021-0 7-22	新发 流通 受限	24.69	31.710 0	201.00	4,962. 69	6,373.71	-
300937	药易 购	2021-0 1-20	2021-0 7-27	新发 流通 受限	12.25	53.710 0	92.00	1,127. 00	4,941.32	-
300948	冠中 生态	2021-0 2-18	2021-0 8-25	新发 流通 受限	8.63	27.420 0	134.00	1,157. 00	3,674.28	-
300952	恒辉 安防	2021-0 3-03	2021-0 9-13	新发 流通 受限	11.72	27.080 0	172.00	2,015. 84	4,657.76	-
300972	万辰 生物	2021-0 4-08	2021-1 0-19	新发 流通 受限	7.19	12.650 0	119.00	855.61	1,505.35	-
301002	崧盛 股份	2021-0 5-27	2021-1 2-07	新发 流通 受限	18.71	57.620 0	96.00	1,796. 16	5,531.52	-
301015	百洋 医药	2021-0 6-22	2021-1 2-30	新发 流通 受限	7.64	38.830 0	199.00	1,520. 36	7,727.17	-
301016	雷尔 伟	2021-0 6-23	2021-1 2-30	新发 流通 受限	13.75	32.980 0	108.00	1,485. 00	3,561.84	-
301021	英诺 激光	2021-0 6-28	2022-0 1-06	新发 流通 受限	9.46	9.4600	1,258. 00	11,900 .68	11,900.68	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金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。本基金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。

本基金管理人建立了由风险管理部、稽核审计部、法律部及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、法律部及合规部等互相配合，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。

6.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	61,741,870.00	17,979,000.00
合计	61,741,870.00	17,979,000.00

注：未评级债券包括期限一年以内的国债、政策性金融债、央行票据及未有第三方机构评级的短期融资券和超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末无余额。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末无余额。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	20,475.01
未评级	-	-
合计	-	20,475.01

注：本报告期末无余额。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末无余额。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末无余额。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。流动性风险一般存在两种形式：资产变现风险和现金流风险。

(1) 资产变现风险

资产变现风险是指由于基金持有的某个券种的头寸相对于市场正常的交易量过大，或由于停牌造成交易无法在当前的市场价格下成交。本基金管理人应用定量方法对各持仓品种的变现能力进行测算和分析，以对资产变现风险进行管理。

(2) 现金流风险

现金流风险是指基金因现金流不足导致无法应对正常基金支付义务的风险。本基金管理人对基金每日和每周净赎回比例进行测算和分析，以对该风险进行跟踪和管理。此外，本基金管理人建立了现金头寸控制机制，以确保赎回款项的及时支付。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申购、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规

模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 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。

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。

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	51,691,900.98	-	-	-	51,691,900.98
结算备付金	24,793,018.04	-	-	-	24,793,018.04
存出保证金	2,226.92	-	-	-	2,226.92
交易性金融资产	61,741,870.00	-	-	796,488,535.47	858,230,405.47
应收证券清算款	-	-	-	11,351,204.30	11,351,204.30
应收利息	-	-	-	955,335.67	955,335.67
应收股利	-	-	-	557,694.18	557,694.18
应收申购款	-	-	-	200,603.33	200,603.33
资产总计	138,229,015.94	-	-	809,553,372.95	947,782,388.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	36,609,672.71	36,609,672.71
应付管理人报酬	-	-	-	1,198,051.06	1,198,051.06

应付托管费	-	-	-	199,675.17	199,675.17
应付销售服务费	-	-	-	496,602.59	496,602.59
应交税费	-	-	-	1,704,823.56	1,704,823.56
其他负债	-	-	-	210,911.22	210,911.22
负债总计	-	-	-	40,419,736.31	40,419,736.31
利率敏感度缺口	138,229,015.94	-	-	769,133,636.64	907,362,652.58
上年度末 2020 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	4,434,639.71	-	-	-	4,434,639.71
结算备付金	17,465,814.52	-	-	-	17,465,814.52
存出保证金	273,757.56	-	-	-	273,757.56
交易性金融资产	17,979,000.00	-	20,475.01	326,586,210.33	344,585,685.34
应收利息	-	-	-	205,215.09	205,215.09
应收申购款	-	-	-	309,359.60	309,359.60
资产总计	40,153,211.79	-	20,475.01	327,100,785.02	367,274,471.82
负债					
应付证券清算款	-	-	-	10,587,528.82	10,587,528.82
应付赎回款	-	-	-	1,361,336.88	1,361,336.88
应付管理人报酬	-	-	-	425,870.94	425,870.94
应付托管费	-	-	-	70,978.52	70,978.52
应付销售服务费	-	-	-	2.59	2.59
应付交易费用	-	-	-	433,006.41	433,006.41
应交税费	-	-	-	2,228,102.98	2,228,102.98
其他负债	-	-	-	100,887.57	100,887.57
负债总计	-	-	-	15,207,714.71	15,207,714.71
利率敏感度缺口	40,153,211.79	-	20,475.01	311,893,070.31	352,066,757.11

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

	影响金额（单位：人民币元）	
	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
市场利率上升 25 个基点	-52,616.63	-21,717.07
市场利率下降 25 个基点	52,752.54	21,773.90

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。

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。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的债券等资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	796,488,535.47	87.78	326,586,210.33	92.76
交易性金融资产—债券投资	61,741,870.00	6.80	17,999,475.01	5.11
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	858,230,405.47	94.59	344,585,685.34	97.88

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准下降 5%	-42,686,792.57	-15,592,606.30
	业绩比较基准上升 5%	42,686,792.57	15,592,606.30

§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	796,488,535.47	84.04
	其中：股票	796,488,535.47	84.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	61,741,870.00	6.51
	其中：债券	61,741,870.00	6.51
	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	76,484,919.02	8.07
8	其他各项资产	13,067,064.40	1.38
9	合计	947,782,388.89	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 232,241,572.41 元，占期末净值比例为 25.60%。

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

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	1,505.35	0.00
B	采矿业	187,200.00	0.02
C	制造业	423,970,729.63	46.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,541,429.10	3.92
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	112,970.25	0.01
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	50,148,588.45	5.53
J	金融业	30,818,828.00	3.40
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	23,462,038.00	2.59
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,674.28	0.00
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	564,246,963.06	62.19

7.2.2 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（%）
信息技术	22,649,650.75	2.50
医疗保健	4,900,333.91	0.54
工业	80,329.25	0.01
房地产	6,581,703.00	0.73
日常消费品	57,884,716.58	6.38
通讯业务	47,608,151.26	5.25
金融	5,664,311.02	0.62
非日常生活消费品	86,872,376.64	9.57
合计	232,241,572.41	25.60

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	占基金资产净值比例(%)
1	002129	中环股份	1,632,000.00	62,995,200.00	6.94
2	600519	贵州茅台	30,000.00	61,701,000.00	6.80
3	00175	吉利汽车	2,727,000.00	55,513,729.89	6.12
4	00700	腾讯控股	97,700.00	47,505,491.68	5.24
5	600803	新奥股份	2,152,600.00	35,539,426.00	3.92
6	300207	欣旺达	917,900.00	29,886,824.00	3.29
7	600745	闻泰科技	302,800.00	29,341,320.00	3.23
8	603501	韦尔股份	76,000.00	24,472,000.00	2.70
9	600438	通威股份	562,200.00	24,326,394.00	2.68
10	002624	完美世界	957,840.00	22,901,954.40	2.52
11	601658	邮储银行	4,515,200.00	22,666,304.00	2.50
12	300122	智飞生物	115,900.00	21,642,007.00	2.39
13	02319	蒙牛乳业	548,000.00	21,421,632.36	2.36
14	00285	比亚迪电子	467,000.00	19,830,034.20	2.19
15	600276	恒瑞医药	278,200.00	18,909,254.00	2.08
16	002027	分众传媒	1,995,800.00	18,780,478.00	2.07
17	002241	歌尔股份	425,830.00	18,199,974.20	2.01
18	00168	青岛啤酒股份	258,000.00	17,958,182.88	1.98
19	300750	宁德时代	31,800.00	17,006,640.00	1.87
20	002230	科大讯飞	214,200.00	14,475,636.00	1.60

21	00291	华润啤酒	248,000.00	14,402,314.80	1.59
22	688002	睿创微纳	141,862.00	14,162,083.46	1.56
23	03690	美团-W	51,600.00	13,765,076.06	1.52
24	02020	安踏体育	90,000.00	13,697,935.20	1.51
25	002475	立讯精密	289,675.00	13,325,050.00	1.47
26	600529	山东药玻	374,000.00	12,697,300.00	1.40
27	300760	迈瑞医疗	20,100.00	9,649,005.00	1.06
28	600588	用友网络	284,170.00	9,451,494.20	1.04
29	600872	中炬高新	218,500.00	9,181,370.00	1.01
30	000100	TCL 科技	1,192,300.00	9,121,095.00	1.01
31	603806	福斯特	84,720.00	8,906,613.60	0.98
32	002142	宁波银行	209,200.00	8,152,524.00	0.90
33	601689	拓普集团	181,992.00	6,811,960.56	0.75
34	06049	保利物业	150,000.00	6,581,703.00	0.73
35	002415	海康威视	94,700.00	6,108,150.00	0.67
36	003021	兆威机电	93,219.00	5,693,816.52	0.63
37	00388	香港交易所	14,700.00	5,664,311.02	0.62
38	002531	天顺风能	625,500.00	5,410,575.00	0.60
39	300751	迈为股份	11,000.00	5,001,700.00	0.55
40	02096	先声药业	421,000.00	4,900,333.91	0.54
41	300573	兴齐眼药	33,300.00	4,696,299.00	0.52
42	601888	中国中免	15,600.00	4,681,560.00	0.52
43	300724	捷佳伟创	36,400.00	4,222,764.00	0.47
44	06186	中国飞鹤	294,000.00	4,102,586.54	0.45
45	603613	国联股份	33,205.00	3,319,503.85	0.37
46	02382	舜宇光学科技	13,800.00	2,819,616.55	0.31
47	01765	希望教育	1,604,000.00	2,497,367.05	0.28
48	01999	敏华控股	90,000.00	1,398,268.44	0.15
49	603979	金诚信	10,400.00	187,200.00	0.02
50	688161	威高骨科	1,729.00	183,360.45	0.02
51	301015	百洋医药	1,985.00	108,028.93	0.01
52	02400	心动公司	1,800.00	102,659.58	0.01
53	603345	安井食品	400.00	101,608.00	0.01
54	02869	绿城服务	8,000.00	80,329.25	0.01
55	301002	崧盛股份	952.00	75,637.92	0.01
56	301016	雷尔伟	1,077.00	45,364.50	0.00
57	688499	利元亨	951.00	36,946.35	0.00
58	688087	英科再生	1,189.00	26,110.44	0.00
59	301021	英诺激光	1,258.00	11,900.68	0.00
60	300932	三友联众	201.00	6,373.71	0.00
61	300937	药易购	92.00	4,941.32	0.00
62	300952	恒辉安防	172.00	4,657.76	0.00
63	300926	博俊科技	181.00	4,018.20	0.00

64	300948	冠中生态	134.00	3,674.28	0.00
65	605319	无锡振华	195.00	3,498.30	0.00
66	300931	通用电梯	218.00	2,857.98	0.00
67	605162	新中港	330.00	2,003.10	0.00
68	300972	万辰生物	119.00	1,505.35	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	600519	贵州茅台	102,840,788.03	29.21
2	00700	腾讯控股	98,373,880.15	27.94
3	002129	中环股份	59,165,913.96	16.81
4	300207	欣旺达	53,062,731.92	15.07
5	600745	闻泰科技	49,008,281.72	13.92
6	600438	通威股份	45,697,001.83	12.98
7	00175	吉利汽车	44,313,132.62	12.59
8	00520	呷哺呷哺	42,945,225.41	12.20
9	00285	比亚迪电子	42,136,118.02	11.97
10	600872	中炬高新	38,736,474.33	11.00
11	601658	邮储银行	35,875,639.56	10.19
12	002230	科大讯飞	34,085,630.97	9.68
13	000100	TCL 科技	28,193,296.00	8.01
14	300750	宁德时代	27,578,247.00	7.83
15	603806	福斯特	27,183,974.00	7.72
16	600803	新奥股份	27,164,094.32	7.72
17	002511	中顺洁柔	27,038,581.70	7.68
18	002624	完美世界	24,622,874.18	6.99
19	600887	伊利股份	23,612,670.00	6.71
20	600588	用友网络	23,561,478.98	6.69
21	603501	韦尔股份	23,152,784.00	6.58
22	600276	恒瑞医药	22,827,187.60	6.48
23	02601	中国太保	21,428,153.19	6.09
24	601318	中国平安	21,127,778.00	6.00
25	600036	招商银行	21,084,285.00	5.99
26	300059	东方财富	20,931,382.00	5.95
27	300122	智飞生物	20,422,734.51	5.80
28	02319	蒙牛乳业	19,369,832.51	5.50
29	002241	歌尔股份	18,303,044.70	5.20
30	002142	宁波银行	18,110,171.88	5.14
31	03690	美团-W	16,624,476.39	4.72
32	00168	青岛啤酒股份	16,412,736.78	4.66

33	02313	申洲国际	16,037,894.39	4.56
34	06862	海底捞	15,731,172.90	4.47
35	600529	山东药玻	14,567,352.70	4.14
36	688002	睿创微纳	13,913,191.59	3.95
37	002475	立讯精密	13,659,559.24	3.88
38	601601	中国太保	13,389,258.88	3.80
39	002027	分众传媒	12,702,985.00	3.61
40	000858	五粮液	12,271,299.00	3.49
41	002415	海康威视	11,618,330.09	3.30
42	600176	中国巨石	10,824,092.93	3.07
43	300751	迈为股份	10,814,710.20	3.07
44	01579	颐海国际	10,256,621.97	2.91
45	300760	迈瑞医疗	9,511,303.00	2.70
46	003021	兆威机电	9,499,651.80	2.70
47	00388	香港交易所	9,087,992.35	2.58
48	688680	海优新材	8,870,924.61	2.52
49	601888	中国中免	8,803,071.00	2.50
50	601012	隆基股份	8,473,595.58	2.41
51	00291	华润啤酒	8,304,654.19	2.36
52	300573	兴齐眼药	7,226,116.00	2.05
53	000002	万科 A	7,136,210.00	2.03

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。

7.4.2 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	600519	贵州茅台	75,410,584.72	21.42
2	00700	腾讯控股	59,671,263.53	16.95
3	600438	通威股份	43,552,289.06	12.37
4	600887	伊利股份	39,990,809.30	11.36
5	00520	呷哺呷哺	36,775,967.07	10.45
6	002511	中顺洁柔	34,613,769.45	9.83
7	300207	欣旺达	32,448,266.86	9.22
8	600872	中炬高新	30,980,446.86	8.80
9	00285	比亚迪电子	25,245,093.80	7.17
10	000858	五粮液	25,205,417.00	7.16
11	603806	福斯特	22,086,217.40	6.27
12	600745	闻泰科技	21,536,357.00	6.12
13	600036	招商银行	21,156,986.00	6.01
14	002230	科大讯飞	21,059,658.46	5.98
15	601888	中国中免	20,808,074.00	5.91
16	601318	中国平安	19,971,793.00	5.67

17	02313	申洲国际	19,792,926.07	5.62
18	300059	东方财富	19,587,638.57	5.56
19	02601	中国太保	17,742,690.00	5.04
20	000100	TCL 科技	16,898,924.86	4.80
21	002129	中环股份	16,277,176.00	4.62
22	000333	美的集团	16,223,485.68	4.61
23	300750	宁德时代	15,017,982.00	4.27
24	600276	恒瑞医药	14,845,452.65	4.22
25	600660	福耀玻璃	14,788,285.00	4.20
26	601012	隆基股份	14,780,051.99	4.20
27	06862	海底捞	13,749,260.68	3.91
28	600588	用友网络	12,939,837.90	3.68
29	600690	海尔智家	12,894,046.00	3.66
30	601601	中国太保	12,110,122.80	3.44
31	01579	颐海国际	11,756,491.52	3.34
32	601658	邮储银行	11,069,723.00	3.14
33	688680	海优新材	10,893,272.08	3.09
34	000001	平安银行	10,735,120.44	3.05
35	002142	宁波银行	10,468,507.66	2.97
36	002624	完美世界	9,796,924.32	2.78
37	600176	中国巨石	9,451,237.99	2.68
38	300573	兴齐眼药	9,284,757.00	2.64
39	300751	迈为股份	9,047,209.60	2.57
40	01999	敏华控股	8,340,151.93	2.37
41	603866	桃李面包	8,053,928.89	2.29
42	000725	京东方 A	7,750,890.00	2.20
43	002415	海康威视	7,428,108.41	2.11
44	00175	吉利汽车	7,268,520.96	2.06
45	000002	万科 A	7,122,542.00	2.02

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

买入股票的成本（成交）总额	1,485,159,224.40
卖出股票的收入（成交）总额	1,050,759,267.48

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。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。

7.5 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	31,723,870.00	3.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,018,000.00	3.31
	其中：政策性金融债	30,018,000.00	3.31
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	61,741,870.00	6.80

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

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	210201	21 国开 01	300,000.00	30,018,000.00	3.31
2	019640	20 国债 10	240,000.00	24,000,000.00	2.65
3	019645	20 国债 15	77,000.00	7,723,870.00	0.85

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

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中，上海韦尔半导体股份有限公司、腾讯控股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，该股票的投资决策程序符合相关法律法规以及基金合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	2,226.92
2	应收证券清算款	11,351,204.30
3	应收股利	557,694.18
4	应收利息	955,335.67
5	应收申购款	200,603.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,067,064.40

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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
中信证券成长动力 A	8,441	36,572.42	13,918,828.54	4.51%	294,788,971.41	95.49%
中信证券成长动力 C	3,582	21,433.58	469,115.42	0.61%	76,305,965.31	99.39%
合计	12,023	32,062.12	14,387,943.96	3.73%	371,094,936.72	96.27%

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	中信证券成长动力 A	5,470,140.34	1.77%
	中信证券成长动力 C	2,794,361.46	3.64%
	合计	8,264,501.80	2.14%

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	中信证券成长动力 A	50~100
	中信证券成长动力 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	中信证券成长动力 A	50~100
	中信证券成长动力 C	0
	合计	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信证券成长动力 A	中信证券成长动力 C
基金合同生效日(2020年11月25日)基金份额总额	149,499,952.33	-
本报告期期初基金份额总额	148,524,544.64	8,783.07
本报告期基金总申购份额	255,226,051.48	188,833,635.06
减：本报告期基金总赎回份额	95,042,796.17	112,067,337.40

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	308,707,799.95	76,775,080.73

注：基金合同生效日：2020 年 11 月 25 日

§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，本基金未召开份额持有人大会。

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、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
中信证券	4	2,537,156,782.29	100.00%	-	-	-

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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期回购成交总	成交金额	占当期权证成交总额的

		额的比例		额的比例		比例
中信证券	17,751,262.20	100.00%	379,900,000.00	100.00%	-	-

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	关于中信证券成长动力混合型集合资产管理计划开放日常定期定额投资的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-10

§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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、中信证券成长动力混合型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、中信证券成长动力混合型集合资产管理计划托管协议；
- 4、中信证券成长动力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。

12.2 存放地点

北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 16 层。

12.3 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

二〇二一年八月三十日