

# 中信证券臻选回报两年持有期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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	34
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.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
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 .....	46
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	46
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	47
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	48
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	48
<b>§12 备查文件目录</b> .....	48
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划		
基金简称	中信证券臻选回报		
基金主代码	900022		
交易代码	900022		
基金运作方式	契约开放式		
基金合同生效日	2020 年 10 月 15 日		
基金管理人	中信证券股份有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	6,720,565,846.42 份		
下属分级基金的基金简称	中信证券臻选回报 A	中信证券臻选回报 B	中信证券臻选回报 C
下属分级基金的交易代码	900022	900052	900152
报告期末下属分级基金的份额总额	30,079,377.05 份	6,178,157,613.19 份	512,328,856.18 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	本集合计划通过大类资产配置，积极发挥选股优势，力争努力控制产品的回撤水平，为集合计划份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本集合计划基于宏观经济研究，确定大类资产配置比例；通过上市公司基本面分析，重点投资于具有行业优势、公司优势和估值优势的股票，获取超额收益，剩余资产将配置于固定收益类和现金类等大类资产上。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+恒生指数收益率×10%+中债综合财富指数收益率×40%
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	梁源	郭明
	联系电话	95548	(010) 66105799
	电子邮箱	liangyuan@citics.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95548	95588

传真	(010) 60836627	(010) 66105798
注册地址	广东省深圳市福田区中心三路 8号卓越时代广场（二期）北座	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址	北京朝阳区亮马桥路48号中信 证券大厦16层	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码	100026	100140
法定代表人	张佑君	陈四清

## 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.cs.ecitic.com">http://www.cs.ecitic.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（2021年1月1日至2021年6月30日）		
	中信证券臻选回报 A	中信证券臻选回报 B	中信证券臻选回报 C
本期已实现收益	-942,042.50	-213,737,697.57	-19,548,884.30
本期利润	3,123,861.89	-32,765,667.46	-4,687,030.13
加权平均基金份额本期利润	0.0899	-0.0063	-0.0109
本期加权平均净值利润率	7.17%	-0.50%	-0.87%
本期基金份额净值增长率	7.22%	7.23%	6.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)		
	中信证券臻选回报 A	中信证券臻选回报 B	中信证券臻选回报 C
期末可供分配利润	-829,962.54	942,391,820.91	75,473,674.25
期末可供分配基金份额利润	-0.0276	0.1525	0.1473
期末基金资产净值	38,635,545.62	7,935,128,806.94	655,165,140.35
期末基金份额净值	1.2845	1.2844	1.2788
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)		

	中信证券臻选回报 A	中信证券臻选回报 B	中信证券臻选回报 C
基金份额累计净值增长率	15.68%	15.67%	15.17%

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

中信证券臻选回报 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	0.94%	0.67%	-1.03%	0.45%	1.97%	0.22%
过去三个月	4.69%	0.66%	2.46%	0.55%	2.23%	0.11%
过去六个月	7.22%	0.82%	1.83%	0.74%	5.39%	0.08%
自基金合同生效起至今	15.68%	0.79%	7.70%	0.67%	7.98%	0.12%

中信证券臻选回报 B

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	0.94%	0.67%	-1.03%	0.45%	1.97%	0.22%
过去三个月	4.69%	0.66%	2.46%	0.55%	2.23%	0.11%
过去六个月	7.23%	0.82%	1.83%	0.74%	5.40%	0.08%
自基金合同生效起至今	15.67%	0.79%	7.70%	0.67%	7.97%	0.12%

中信证券臻选回报 C

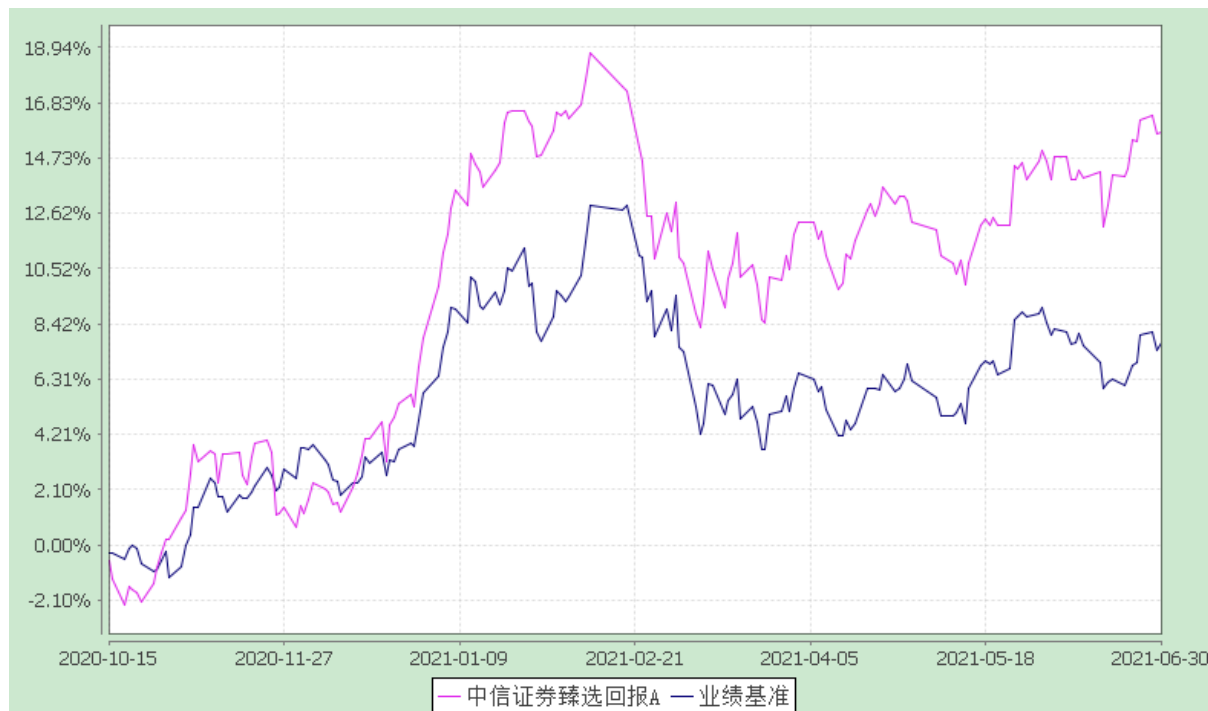
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.88%	0.67%	-1.03%	0.45%	1.91%	0.22%
过去三个月	4.50%	0.66%	2.46%	0.55%	2.04%	0.11%
过去六个月	6.86%	0.82%	1.83%	0.74%	5.03%	0.08%
自基金合同生效起至今	15.17%	0.79%	7.70%	0.67%	7.47%	0.12%

#### 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

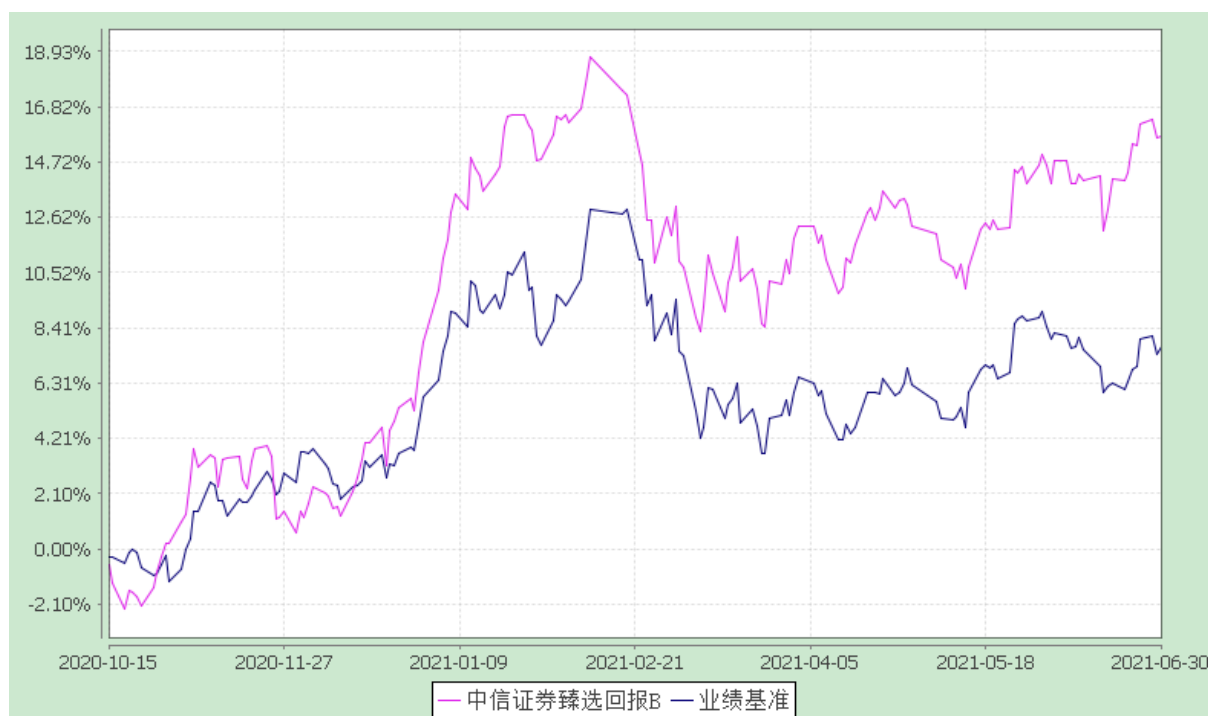
较

中信证券臻选回报两年持有期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 10 月 15 日至 2021 年 6 月 30 日)

中信证券臻选回报 A

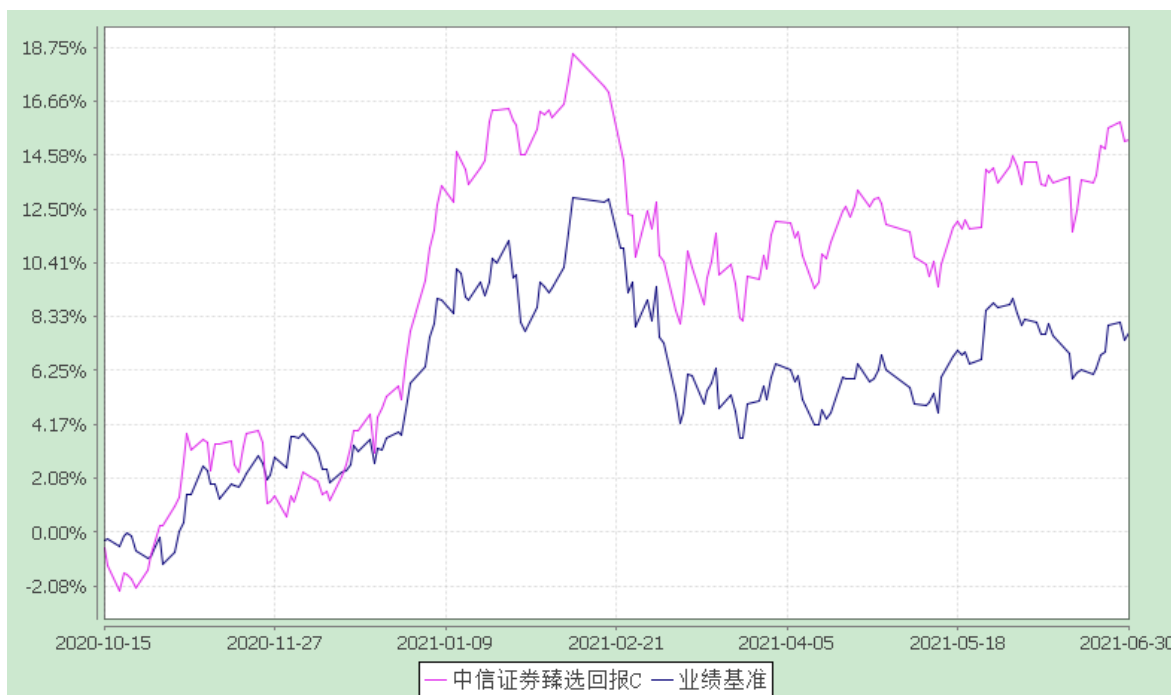


中信证券臻选回报 B



中信证券臻选回报 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		
张燕珍	本基金的基金经理	2020-10-15	-	10	2011 年加入中信证券资产管理业务部,目前为中信证券资产管理业务执行总经理。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
张燕珍	公募基金	2	15,075,173,693.79	2020 年 02 月 18 日
	私募资产管理计划	2	216,837,837.14	2015 年 10 月 23 日
	其他组合	10	12,036,702,019.80	2018 年 02 月 01 日
	合计	14	27,328,713,550.73	

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，A 股市场行业板块轮动较快，沪深 300 上涨 0.24%，上证指数上涨 3.4%，创业板指数上涨 17.22%；港股市场相对弱一些，恒生指数上涨 5.86%，恒生中国企业指数下跌 0.7%。今年上半年一季度主要是对通胀、PPI 处于高位，对货币政策收紧的担忧引发高估值板块的调整；二季度国内政府政策的维稳导向下，投资的风险偏好明显提升，叠加一些行业板块基本面数据的超预期，使得整体市场迎来比较好的反弹。市场风格方面，基础化工、钢铁、煤炭和电力设备涨幅靠前，非银金融、家电、军工跌幅较大，消费除医药和汽车外涨幅靠后。上半年 A 股市场主要是周期股，2 季度则开始转向成长股。分析背后的原因：一是去年在疫情、美国制裁等事件影响，基本面叠加情绪，给与确定性更高的一些价值股更高的估值，高估值板块今年自然要消化前期的估值；二是基本面角度，去年疫情一些消费板块的高基数，今年上半年消费基本面较弱。在国内走出疫情，欧美疫情缓解，拜登解除禁令，都对周期和成长股有利。中报预报也是成长>周期>价值，因此价值股逐步被市场遗忘。今年上涨的主要是估值处于底部个股的反弹和行业景气度进一步超预期的板块以及科创板以及新股的机会。

本集合计划，在今年 1 月份进行了新资金的募集，管理人在 1 季度高位加仓比较谨慎，在 2 季度逐步提高仓位，主要加仓了港股的消费、医药，A 股的制造等板块的持仓，降低了 A 股的大消费和医药，以及港股科技板块的持仓。个股方面，依然坚持 GARP 策略，自下而上选择景气度较好、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，中信证券臻选回报 A 基金份额净值为 1.2845 元，本报告期份额净值

增长率为 7.22%;中信证券臻选回报 B 基金份额净值为 1.2844 元,本报告期份额净值增长率为 7.23%;中信证券臻选回报 C 基金份额净值为 1.2788 元,本报告期份额净值增长率为 6.86%,同期业绩比较基准增长率为 1.83%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济基本面来看,上半年国内外疫情虽有局部反复,目前全球疫情有进一步抬头的趋势,但整体都处在全球共振复苏的趋势之中。展望 2021 年下半年,疫情方面国内防控得力、政治局经济工作会议结束,整体态度中性偏松,管理人认为经济量价齐升,恢复斜率最快的阶段已经过去,整体将进入平稳发展的阶段。但从更长周期维度,管理人对国内经济的长期发展,国内企业在全球竞争力的提升,行业竞争和龙头企业的发展还是充满信心的。

从证券市场来看,目前流动性、投资者的风险偏好是处于比较高的阶段,经过过去几年的估值变化,市场整体来说,过去给与了确定较高、稳健成长的一些大盘价值相对较高的估值,有些股票出现了明显的溢价。但中证/500,中证 1000 整体的估值还是处于非常低的估值百分位,管理人判断市场很难有指数性的机会,主要是结构性机会为主。管理人认为市场更多的机会来自这些估值相对合理或者景气度持续超预期的板块,但是选股的难度和不确定在加大。

本账户,继续保持耐心,在市场波动中提高仓位、调整结构,管理人将继续聚焦于在符合产业转型升级、商业模式突出、竞争格局较好、公司竞争力强的这批优质企业,在这里面自下而上选择景气度较好、估值合理、符合预期收益率的优质个股。

#### 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，中国工商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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中信证券臻选回报两年持有期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	64,715,410.17	1,382,934.44
结算备付金		1,267,074,415.75	8,027,972.33
存出保证金		-	11,745.57
交易性金融资产	6.4.7.2	6,749,578,481.99	41,358,796.68
其中：股票投资		6,299,058,481.99	41,358,796.68
基金投资		-	-
债券投资		450,520,000.00	-
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	531,890,787.54	-
应收证券清算款		20,148,739.17	-
应收利息	6.4.7.5	6,908,528.01	948.78
应收股利		4,035,371.74	-
应收申购款		748,553.49	57,527.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		8,645,100,287.86	50,839,924.80
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,643,548.44	55,816.80
应付管理人报酬		5,613,471.37	474,039.00
应付托管费		701,683.91	30,334.80
应付销售服务费		1,096,565.91	1,114.14
应付交易费用	6.4.7.7	7,494.60	1,855.06
应交税费		6,948,523.35	225,626.08
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	159,507.37	100,000.00
负债合计		16,170,794.95	888,785.88
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	6,720,565,846.42	41,696,666.26
未分配利润	6.4.7.10	1,908,363,646.49	8,254,472.66
所有者权益合计		8,628,929,492.91	49,951,138.92
负债和所有者权益总计		8,645,100,287.86	50,839,924.80

注：1.报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 6,720,565,846.42 份，其中 A 类基金份额

净值 1.2845 元，基金份额总额 30,079,377.05 份；B 类基金份额净值 1.2844 元，基金份额总额 6,178,157,613.19 份；C 类基金份额净值 1.2788 元，基金份额总额 512,328,856.18 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中信证券臻选回报两年持有期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
<b>一、收入</b>		<b>16,462,340.94</b>
1.利息收入		14,593,876.94
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,593,356.17
债券利息收入		3,983,727.41
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		7,016,793.36
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-198,031,329.61
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-234,064,607.95
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	1,627,262.27
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	34,406,016.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	199,899,788.67
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	4.94
<b>减：二、费用</b>		<b>50,791,176.64</b>
1. 管理人报酬		28,320,035.19
2. 托管费		3,540,004.40
3. 销售服务费		1,884,544.26
4. 交易费用	6.4.7.21	16,893,486.37
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		7,918.50
7. 其他费用	6.4.7.22	145,187.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-34,328,835.70</b>
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-34,328,835.70
-------------------	--	----------------

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信证券臻选回报两年持有期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）	41,696,666.26	8,254,472.66	49,951,138.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-34,328,835.70	-34,328,835.70
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）	6,678,869,180.16	1,934,438,009.53	8,613,307,189.69
其中：1.基金申购款	6,688,050,167.36	1,936,780,504.19	8,624,830,671.55
2.基金赎回款	-9,180,987.20	-2,342,494.66	-11,523,481.86
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）	6,720,565,846.42	1,908,363,646.49	8,628,929,492.91

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

中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划(以下简称“本基金”)是由中信证券理财优选集合资产管理计划转型而来。中信证券臻选回报两年持有期混合型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 9 月 18 日发布《中信证券理财优选集合资产管理计划变更的公告》。根据公告，中信证券理财优选集合资产管理计划名称变更为“中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划”，中信证券理财优选集合资产管理计划份额转换为中信证券臻选回报两年持有期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 10 月 15 日起《中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《中信证券臻选回报



两年持有期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”),托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信证券臻选回报两年持有期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:50%×沪深 300 指数收益率+10%×恒生指数收益率+40%×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》、《中信证券臻选回报两年持有期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 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。

## 6.4.5 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	64,715,410.17
定期存款	-
其他存款	-
合计	64,715,410.17

### 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	6,086,479,867.11	6,299,058,481.99	212,578,614.88	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	450,093,330.00	450,520,000.00	426,670.00
	合计	450,093,330.00	450,520,000.00	426,670.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	6,536,573,197.11	6,749,578,481.99	213,005,284.88	

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	531,890,787.54	-
合计	531,890,787.54	-

#### 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	86,172.16
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	82,934.83
应收债券利息	6,669,589.04
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	69,831.98
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	-
合计	6,908,528.01

### 6.4.7.6 其他资产

无。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	7,494.60
合计	7,494.60

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
其他	159,507.37
合计	159,507.37

#### 6.4.7.9 实收基金

中信证券臻选回报 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	39,260,364.25	39,260,364.25
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-9,180,987.20	-9,180,987.20
本期末	30,079,377.05	30,079,377.05

中信证券臻选回报 B

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	426,850.98	426,850.98
本期申购	6,177,730,762.21	6,177,730,762.21
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	6,178,157,613.19	6,178,157,613.19
-----	------------------	------------------

中信证券臻选回报 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	2,009,451.03	2,009,451.03
本期申购	510,319,405.15	510,319,405.15
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	512,328,856.18	512,328,856.18

#### 6.4.7.10 未分配利润

中信证券臻选回报 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	35,695.90	7,739,105.44	7,774,801.34
本期利润	-942,042.50	4,065,904.39	3,123,861.89
本期基金份额交易产生的变动数	76,384.06	-2,418,878.72	-2,342,494.66
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	76,384.06	-2,418,878.72	-2,342,494.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-829,962.54	9,386,131.11	8,556,168.57

中信证券臻选回报 B

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	77,213.12	7,228.45	84,441.57
本期利润	-213,737,697.57	180,972,030.11	-32,765,667.46
本期基金份额交易产生的变动数	1,156,052,305.36	633,600,114.28	1,789,652,419.64
其中：基金申购款	1,156,052,305.36	633,600,114.28	1,789,652,419.64
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	942,391,820.91	814,579,372.84	1,756,971,193.75

中信证券臻选回报 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	361,380.54	33,849.21	395,229.75
本期利润	-19,548,884.30	14,861,854.17	-4,687,030.13
本期基金份额交易产生的变动数	94,661,178.01	52,466,906.54	147,128,084.55
其中：基金申购款	94,661,178.01	52,466,906.54	147,128,084.55
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,473,674.25	67,362,609.92	142,836,284.17

#### 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	1,123,920.18
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	2,469,433.90
其他	2.09
合计	3,593,356.17

#### 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	2,983,073,006.11
减：卖出股票成本总额	3,217,137,614.06
买卖股票差价收入	-234,064,607.95

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	254,781,602.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	249,904,000.00

减：应收利息总额	3,250,339.93
买卖债券差价收入	1,627,262.27

#### 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	34,406,016.07
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	34,406,016.07

#### 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	206,640,688.81
——股票投资	206,214,018.81
——债券投资	426,670.00
——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	6,740,900.14
合计	199,899,788.67

#### 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	4.94
合计	4.94

#### 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	16,890,386.37
银行间市场交易费用	3,100.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	16,893,486.37

#### 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	12,000.00
银行划款费	8,349.46
其他	65,331.09
合计	145,187.92

### 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
工商银行	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
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
中国中信有限公司	基金管理人股东
中信银行股份有限公司	基金销售机构

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	12,251,762,264.19	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	1,531,262.27	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	62,857,800,000.00	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	9,842,048.65	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	28,320,035.19
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 0.80% 的年费率计提，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

##### 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	3,540,004.40

注：支付托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

##### 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			
	中信证券臻选回报 A	中信证券臻选回报	中信证券臻选回报 C	合计

		B		
中信证券	-	-	1,378,358.51	1,378,358.51
中信期货有 限公司	-	-	8,091.01	8,091.01
中信证券 (山东)有 限责任公司	-	-	228,353.34	228,353.34
中信证券华 南股份有限 公司	-	-	92,468.68	92,468.68
上海华夏财 富投资管理 有限公司	-	-	44,815.14	44,815.14
中信银行股 份有限公司	-	-	72,547.45	72,547.45
合计	-	-	1,824,634.13	1,824,634.13

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 0.70% 的年费率计提，按月支付。A 类基金份额和 B 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类资产净值} \times 0.70\% / \text{当年天数}。$$

#### 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
工商银行	64,715,410.17	1,123,920.18

注：本基金的银行存款由托管行工商银行保管，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

无。

##### 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	450,520,000.00	-
合计	450,520,000.00	-

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

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	64,715,410.17	-	-	-	64,715,410.17
结算备付金	1,267,074,415.75	-	-	-	1,267,074,415.75
交易性金融资产	450,520,000.00	-	-	6,299,058,481.99	6,749,578,481.99
买入返售金融资产	531,890,787.54	-	-	-	531,890,787.54
应收证券清算款	-	-	-	20,148,739.17	20,148,739.17
应收利息	-	-	-	6,908,528.01	6,908,528.01
应收股利	-	-	-	4,035,371.74	4,035,371.74
应收申购款	-	-	-	748,553.49	748,553.49
资产总计	2,314,200,613.46	-	-	6,330,899,674.40	8,645,100,287.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,643,548.44	1,643,548.44
应付管理人报酬	-	-	-	5,613,471.37	5,613,471.37
应付托管费	-	-	-	701,683.91	701,683.91
应付销售服务费	-	-	-	1,096,565.91	1,096,565.91
应付交易费用	-	-	-	7,494.60	7,494.60
应交税费	-	-	-	6,948,523.35	6,948,523.35
其他负债	-	-	-	159,507.37	159,507.37
负债总计	-	-	-	16,170,794.95	16,170,794.95
利率敏感度缺口	2,314,200,613.46	-	-	6,314,728,879.45	8,628,929,492.91
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	1,382,934.44	-	-	-	1,382,934.44
结算备付金	8,027,972.33	-	-	-	8,027,972.33
存出保证金	11,745.57	-	-	-	11,745.57
交易性金融资产	-	-	-	41,358,796.68	41,358,796.68



应收利息	-	-	-	948.78	948.78
应收申购款	-	-	-	57,527.00	57,527.00
资产总计	9,422,652.34	-	-	41,417,272.46	50,839,924.80
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	55,816.80	55,816.80
应付管理人报酬	-	-	-	474,039.00	474,039.00
应付托管费	-	-	-	30,334.80	30,334.80
应付销售服务费	-	-	-	1,114.14	1,114.14
应付交易费用	-	-	-	1,855.06	1,855.06
应交税费	-	-	-	225,626.08	225,626.08
其他负债	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	888,785.88	888,785.88
利率敏感度缺口	9,422,652.34	-	-	40,528,486.58	49,951,138.92

#### 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	-482,841.87	0.00
	市场利率下降 25 个基点	484,066.23	0.00

#### 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	上年度末
	2021 年 6 月 30 日	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	6,299,058,481.99	73.00	41,358,796.68	82.80
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	450,520,000.00	5.22	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>6,749,578,481.99</b>	<b>78.22</b>	<b>41,358,796.68</b>	<b>82.80</b>

#### 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%	-235,014,765.74	-1,403,425.64
	业绩比较基准上升 5%	235,014,765.74	1,403,425.64

## §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	6,299,058,481.99	72.86
	其中：股票	6,299,058,481.99	72.86
2	固定收益投资	450,520,000.00	5.21
	其中：债券	450,520,000.00	5.21
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-

4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	531,890,787.54	6.15
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,331,789,825.92	15.41
7	其他各项资产	31,841,192.41	0.37
8	合计	8,645,100,287.86	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 2,735,195,499.62 元，占期末净值比例为 31.70%。

## 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,765,291,682.39	32.05
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	14,666,627.82	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	39,719,590.00	0.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	51,229,710.55	0.59
J	金融业	454,785,162.10	5.27
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	183,083,547.75	2.12
M	科学研究和技术服务业	11,975,421.28	0.14
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	43,111,240.48	0.50
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	3,563,862,982.37	41.30

### 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	148,773,464.04	1.72
医疗保健	435,576,929.69	5.05
工业	13,639,486.68	0.16
日常消费品	515,732,205.92	5.98
通讯业务	304,239,366.88	3.53
非日常生活消费品	1,317,234,046.41	15.27
合计	2,735,195,499.62	31.70

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	00175	吉利汽车	28,453,000.00	579,219,712.71	6.71
2	600519	贵州茅台	270,215.00	555,751,190.50	6.44
3	02020	安踏体育	2,246,000.00	341,839,582.88	3.96
4	300059	东方财富	9,345,222.00	306,429,829.38	3.55
5	00700	腾讯控股	625,700.00	304,239,366.88	3.53
6	002129	中环股份	7,077,097.00	273,175,944.20	3.17
7	00168	青岛啤酒股份	3,390,000.00	235,962,170.40	2.73
8	002415	海康威视	3,539,165.00	228,276,142.50	2.65
9	00291	华润啤酒	3,370,000.00	195,708,874.50	2.27
10	300750	宁德时代	356,578.00	190,697,914.40	2.21
11	002027	分众传媒	19,456,275.00	183,083,547.75	2.12
12	601012	隆基股份	1,989,775.00	176,771,611.00	2.05
13	000725	京东方 A	27,889,905.00	174,033,007.20	2.02
14	002475	立讯精密	3,665,610.00	168,618,060.00	1.95
15	600036	招商银行	2,406,124.00	130,387,859.56	1.51
16	00853	微创医疗	2,230,000.00	129,319,015.70	1.50
17	00285	比亚迪电子	2,936,000.00	124,670,193.60	1.44
18	02331	李宁	1,511,000.00	119,263,955.28	1.38
19	601799	星宇股份	502,928.00	113,520,908.16	1.32

20	603517	绝味食品	1,323,778.00	111,581,247.62	1.29
21	03690	美团-W	415,000.00	110,707,491.60	1.28
22	06078	海吉亚医疗	1,279,000.00	108,619,330.80	1.26
23	01093	石药集团	10,298,000.00	96,373,050.35	1.12
24	300274	阳光电源	792,200.00	91,150,532.00	1.06
25	06186	中国飞鹤	6,024,000.00	84,061,161.02	0.97
26	000858	五粮液	228,195.00	67,977,008.55	0.79
27	601966	玲珑轮胎	1,431,154.00	62,598,675.96	0.73
28	01316	耐世特	6,848,000.00	61,577,763.84	0.71
29	600276	恒瑞医药	833,968.00	56,684,804.96	0.66
30	603218	日月股份	1,864,800.00	50,498,784.00	0.59
31	603378	亚士创能	884,975.00	48,691,324.50	0.56
32	002847	盐津铺子	448,585.00	44,732,896.20	0.52
33	00425	敏实集团	1,438,000.00	44,179,587.72	0.51
34	002371	北方华创	158,900.00	44,075,682.00	0.51
35	300143	盈康生命	1,673,573.00	43,111,240.48	0.50
36	603816	顾家家居	541,549.00	41,850,906.72	0.49
37	002511	中顺洁柔	1,508,550.00	41,560,552.50	0.48
38	002352	顺丰控股	586,700.00	39,719,590.00	0.46
39	002311	海大集团	430,515.00	35,130,024.00	0.41
40	300979	华利集团	298,689.00	34,020,677.10	0.39
41	601636	旗滨集团	1,803,100.00	33,465,536.00	0.39
42	603613	国联股份	324,365.00	32,426,769.05	0.38
43	002271	东方雨虹	555,100.00	30,708,132.00	0.36
44	01951	锦欣生殖	1,562,000.00	25,490,215.52	0.30
45	01530	三生制药	3,053,500.00	24,406,503.36	0.28
46	01810	小米集团-W	1,072,200.00	24,103,270.44	0.28
47	09995	荣昌生物-B	243,500.00	24,004,191.04	0.28
48	300124	汇川技术	299,550.00	22,244,583.00	0.26
49	06169	宇华教育	3,756,000.00	21,984,536.57	0.25
50	03669	永达汽车	1,788,500.00	20,698,560.89	0.24
51	002695	煌上煌	1,214,384.00	19,223,698.72	0.22
52	01515	华润医疗	2,401,000.00	18,851,254.62	0.22
53	000001	平安银行	794,318.00	17,967,473.16	0.21
54	03998	波司登	3,844,000.00	17,762,854.92	0.21
55	603233	大参林	286,962.00	14,666,627.82	0.17
56	02128	中国联塑	855,000.00	13,639,486.68	0.16
57	688002	睿创微纳	134,620.00	13,439,114.60	0.16
58	002230	科大讯飞	178,425.00	12,057,961.50	0.14
59	601058	赛轮轮胎	1,114,100.00	11,129,859.00	0.13
60	603259	药明康德	70,080.00	10,973,827.20	0.13
61	000913	钱江摩托	555,500.00	9,926,785.00	0.12
62	002791	坚朗五金	44,800.00	8,693,440.00	0.10
63	002410	广联达	98,900.00	6,744,980.00	0.08

64	02096	先声药业	464,000.00	5,400,843.07	0.06
65	002572	索菲亚	209,200.00	5,062,640.00	0.06
66	00460	四环医药	1,126,000.00	3,112,525.23	0.04
67	688179	阿拉丁	7,142.00	1,001,594.08	0.01

#### 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	734,506,937.76	1,470.45
2	00700	腾讯控股	512,512,488.80	1,026.03
3	00175	吉利汽车	490,558,563.43	982.08
4	002129	中环股份	341,773,409.83	684.22
5	000725	京东方 A	307,031,525.61	614.66
6	600036	招商银行	282,953,954.87	566.46
7	300059	东方财富	280,898,567.82	562.35
8	02020	安踏体育	249,224,067.43	498.94
9	002415	海康威视	232,258,818.81	464.97
10	00168	青岛啤酒股份	228,542,405.85	457.53
11	00291	华润啤酒	188,410,460.73	377.19
12	002027	分众传媒	184,631,246.96	369.62
13	300750	宁德时代	181,914,491.79	364.18
14	002475	立讯精密	171,174,758.67	342.68
15	601012	隆基股份	168,897,458.30	338.13
16	06186	中国飞鹤	165,961,044.87	332.25
17	000001	平安银行	160,102,651.33	320.52
18	00285	比亚迪电子	154,007,295.09	308.32
19	601799	星宇股份	146,965,039.46	294.22
20	06862	海底捞	143,689,705.67	287.66
21	600989	宝丰能源	122,041,218.40	244.32
22	00853	微创医疗	121,399,607.43	243.04
23	03690	美团-W	121,232,377.13	242.70
24	603899	晨光文具	121,174,596.90	242.59
25	603517	绝味食品	119,357,519.24	238.95
26	01093	石药集团	105,545,215.41	211.30
27	00941	中国移动	103,640,842.04	207.48
28	002539	云图控股	102,512,565.11	205.23
29	02331	李宁	98,898,434.35	197.99
30	603816	顾家家居	85,290,006.77	170.75
31	600438	通威股份	83,263,760.46	166.69

32	02689	玖龙纸业	81,724,717.35	163.61
33	600176	中国巨石	80,195,243.64	160.55
34	06078	海吉亚医疗	79,372,169.09	158.90
35	03323	中国建材	78,629,671.40	157.41
36	002511	中顺洁柔	78,257,531.18	156.67
37	002791	坚朗五金	77,063,397.00	154.28
38	002847	盐津铺子	76,704,266.02	153.56
39	300274	阳光电源	75,887,007.10	151.92
40	000002	万科 A	74,672,456.80	149.49
41	03606	福耀玻璃	72,581,179.32	145.30
42	601888	中国中免	72,510,197.04	145.16
43	600745	闻泰科技	69,666,360.00	139.47
44	601966	玲珑轮胎	68,557,107.62	137.25
45	01316	耐世特	67,538,710.29	135.21
46	002271	东方雨虹	64,565,055.86	129.26
47	600276	恒瑞医药	59,914,200.60	119.95
48	300073	当升科技	57,810,330.45	115.73
49	000858	五粮液	57,358,070.81	114.83
50	000910	大亚圣象	53,345,930.50	106.80
51	603218	日月股份	51,647,269.99	103.40
52	002311	海大集团	47,849,549.82	95.79
53	603259	药明康德	45,252,925.38	90.59
54	00425	敏实集团	43,811,333.83	87.71
55	002371	北方华创	43,048,591.40	86.18
56	603378	亚士创能	42,195,578.00	84.47
57	300143	盈康生命	41,978,462.39	84.04
58	002352	顺丰控股	41,576,027.53	83.23
59	00027	银河娱乐	40,790,080.43	81.66
60	000100	TCL 科技	39,787,487.49	79.65
61	002410	广联达	38,979,803.00	78.04
62	002695	煌上煌	37,757,567.12	75.59
63	002236	大华股份	36,866,461.40	73.81
64	603613	国联股份	36,796,393.03	73.66
65	01951	锦欣生殖	35,879,805.97	71.83
66	02318	中国平安	35,135,949.08	70.34
67	06049	保利物业	34,243,176.73	68.55
68	601916	浙商银行	33,837,395.95	67.74
69	603806	福斯特	33,012,026.00	66.09
70	300979	华利集团	30,313,527.21	60.69
71	00520	呷哺呷哺	29,035,564.08	58.13
72	01810	小米集团-W	25,482,242.98	51.01
73	601636	旗滨集团	23,788,326.00	47.62
74	600872	中炬高新	23,678,326.39	47.40
75	002876	三利谱	23,146,833.50	46.34

76	01530	三生制药	23,107,203.08	46.26
77	000902	新洋丰	22,309,505.72	44.66
78	603606	东方电缆	22,178,448.16	44.40
79	09995	荣昌生物-B	21,894,319.65	43.83
80	06169	宇华教育	21,755,948.71	43.55
81	01812	晨鸣纸业	21,738,674.12	43.52
82	01515	华润医疗	21,086,843.55	42.21
83	605006	山东玻纤	20,514,671.69	41.07
84	300124	汇川技术	20,360,076.00	40.76
85	600741	华域汽车	20,254,281.52	40.55
86	000488	晨鸣纸业	19,976,767.00	39.99
87	03669	永达汽车	19,930,045.64	39.90
88	01765	希望教育	19,587,104.31	39.21
89	01999	敏华控股	18,405,438.96	36.85
90	603233	大参林	17,580,418.15	35.20
91	01579	颐海国际	15,414,048.42	30.86
92	02128	中国联塑	15,296,599.50	30.62
93	300144	宋城演艺	15,219,902.22	30.47
94	03998	波司登	14,755,008.50	29.54
95	000703	恒逸石化	14,553,107.40	29.13
96	688002	睿创微纳	13,187,073.89	26.40
97	688608	恒玄科技	11,531,309.34	23.09
98	601058	赛轮轮胎	10,730,210.94	21.48
99	002230	科大讯飞	9,942,975.78	19.91
100	000913	钱江摩托	9,936,108.47	19.89
101	600570	恒生电子	8,016,703.27	16.05
102	603208	江山欧派	6,998,224.40	14.01
103	000333	美的集团	5,769,941.00	11.55
104	600406	国电南瑞	5,491,009.93	10.99
105	002572	索菲亚	4,999,740.00	10.01
106	02096	先声药业	4,844,996.73	9.70
107	03898	中车时代电气	4,764,671.47	9.54
108	00981	中芯国际	4,635,103.05	9.28
109	00460	四环医药	3,183,812.73	6.37
110	02601	中国太保	2,751,853.09	5.51
111	01888	建滔积层板	1,362,133.08	2.73
112	688179	阿拉丁	999,880.00	2.00

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	164,864,927.75	330.05
2	600036	招商银行	151,761,505.50	303.82
3	603899	晨光文具	141,469,454.17	283.22
4	000001	平安银行	138,952,113.65	278.18
5	000725	京东方 A	116,659,786.87	233.55
6	00700	腾讯控股	113,602,571.98	227.43
7	06862	海底捞	101,958,669.58	204.12
8	002539	云图控股	98,329,020.10	196.85
9	00941	中国移动	96,133,695.88	192.46
10	600989	宝丰能源	92,898,247.28	185.98
11	600438	通威股份	87,217,033.82	174.60
12	002129	中环股份	81,639,129.38	163.44
13	601888	中国中免	80,031,022.60	160.22
14	03606	福耀玻璃	78,869,780.75	157.89
15	002791	坚朗五金	75,530,323.00	151.21
16	000002	万科 A	71,246,975.10	142.63
17	600176	中国巨石	69,029,841.45	138.19
18	03323	中国建材	68,057,390.52	136.25
19	600745	闻泰科技	63,382,535.40	126.89
20	02689	玖龙纸业	58,098,720.60	116.31
21	06186	中国飞鹤	49,319,410.36	98.74
22	300073	当升科技	48,759,705.90	97.61
23	000910	大亚圣象	47,228,996.16	94.55
24	00027	银河娱乐	42,578,606.85	85.24
25	603816	顾家家居	34,800,761.91	69.67
26	601799	星宇股份	34,730,732.00	69.53
27	603259	药明康德	34,707,025.78	69.48
28	002511	中顺洁柔	34,048,288.09	68.16
29	002410	广联达	34,017,626.15	68.10
30	000100	TCL 科技	32,738,356.30	65.54
31	002271	东方雨虹	32,284,528.88	64.63
32	002236	大华股份	32,013,933.44	64.09
33	601916	浙商银行	31,516,730.00	63.10
34	603806	福斯特	30,738,103.00	61.54
35	06049	保利物业	30,479,977.19	61.02
36	002847	盐津铺子	30,059,038.84	60.18
37	02318	中国平安	28,954,055.65	57.96
38	600872	中炬高新	25,122,536.92	50.29
39	002876	三利谱	23,526,420.35	47.10
40	000902	新洋丰	22,972,285.61	45.99
41	01999	敏华控股	22,085,905.62	44.22
42	03690	美团-W	21,643,140.48	43.33

43	605006	山东玻纤	19,024,919.83	38.09
44	01812	晨鸣纸业	18,881,829.38	37.80
45	603606	东方电缆	18,879,193.48	37.80
46	01951	锦欣生殖	17,793,043.76	35.62
47	600741	华域汽车	17,686,841.00	35.41
48	00285	比亚迪电子	17,520,660.57	35.08
49	00520	呷哺呷哺	17,243,920.28	34.52
50	000488	晨鸣纸业	16,532,628.00	33.10
51	300144	宋城演艺	16,460,472.90	32.95
52	01765	希望教育	15,394,440.67	30.82
53	688608	恒玄科技	14,834,046.47	29.70
54	603517	绝味食品	12,875,594.00	25.78
55	002311	海大集团	12,415,423.50	24.86
56	000703	恒逸石化	11,971,692.22	23.97
57	01579	颐海国际	11,794,307.32	23.61
58	002695	煌上煌	8,434,036.00	16.88
59	000333	美的集团	7,450,000.00	14.91
60	600570	恒生电子	7,355,451.51	14.73
61	603208	江山欧派	7,050,417.60	14.11
62	600406	国电南瑞	5,698,435.02	11.41
63	00981	中芯国际	4,698,234.01	9.41
64	03898	中车时代电气	4,298,871.93	8.61
65	02128	中国联塑	3,770,956.02	7.55
66	300558	贝达药业	2,916,088.00	5.84
67	000568	泸州老窖	2,778,400.00	5.56
68	02601	中国太保	2,296,539.92	4.60
69	600660	福耀玻璃	2,207,608.00	4.42
70	002304	洋河股份	1,818,034.00	3.64
71	600346	恒力石化	1,604,141.00	3.21
72	300529	健帆生物	1,487,701.00	2.98
73	01888	建滔积层板	1,462,417.71	2.93
74	03669	永达汽车	1,144,101.03	2.29

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	9,268,623,280.56
卖出股票的收入（成交）总额	2,983,073,006.11

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	450,520,000.00	5.22
	其中：政策性金融债	450,520,000.00	5.22
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	450,520,000.00	5.22

### 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	200216	20 国开 16	2,000,000.00	200,340,000.00	2.32
2	210201	21 国开 01	2,000,000.00	200,120,000.00	2.32
3	210301	21 进出 01	500,000.00	50,060,000.00	0.58

### 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，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	应收证券清算款	20,148,739.17
3	应收股利	4,035,371.74
4	应收利息	6,908,528.01
5	应收申购款	748,553.49
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,841,192.41

#### 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
中信证券臻选回报 A	534	56,328.42	1,075,783.03	3.58%	29,003,594.02	96.42%
中信证券臻选回报 B	97,128	63,608.41	133,415,158.68	2.16%	6,044,742,454.51	97.84%
中信证券臻选回报 C	7,792	65,750.62	7,983,121.70	1.56%	504,345,734.48	98.44%
合计	105,454	63,729.83	142,474,063.41	2.12%	6,578,091,783.01	97.88%

### 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	中信证券臻选回报 A	-	-
	中信证券臻选回报 B	45,618,558.46	0.74%
	中信证券臻选回报 C	4,920,246.20	0.96%
	合计	50,538,804.66	0.75%

### 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	中信证券臻选回报 A	0
	中信证券臻选回报 B	0
	中信证券臻选回报 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中信证券臻选回报 A	0
	中信证券臻选回报 B	0
	中信证券臻选回报 C	0
	合计	0

### 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信证券臻选回报 A	中信证券臻选回报 B	中信证券臻选回报 C
基金合同生效日（2020 年 10 月 15 日）基金份额总额	49,046,130.88	-	-
本报告期期初基金份额总额	39,260,364.25	426,850.98	2,009,451.03
本报告期基金总申购份额	-	6,177,730,762.21	510,319,405.15
减：本报告期基金总赎回份额	9,180,987.20	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份	30,079,377.05	6,178,157,613.19	512,328,856.18

额总额			
-----	--	--	--

注：基金合同生效日：2020 年 10 月 15 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，中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 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	12,251,762,264.19	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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

中信证券	1,531,262.27	100.00%	62,857,800,000.00	100.00%	-	-
------	--------------	---------	-------------------	---------	---	---

## 10.8 其他重大事件

无。

## §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、中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划托管协议；
- 4、中信证券臻选回报两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。

### 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