

中信证券红利价值一年持有混合型集合资产管理计划

2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：中信证券股份有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

§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 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	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.....	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.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53

7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§9 开放式基金份额变动	55
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
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
§11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信证券红利价值一年持有混合型集合资产管理计划		
基金简称	中信证券红利价值		
基金主代码	900011		
交易代码	900011		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2019 年 10 月 22 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	5,017,741,405.78 份		
下属分级基金的基金简称	中信证券红利价值 A	中信证券红利价值 B	中信证券红利价值 C
下属分级基金的交易代码	900011	900099	900089
报告期末下属分级基金的 份额总额	201,118,049.35 份	3,556,135,725.60 份	1,260,487,630.83 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	本集合计划在严格执行投资风险管理的的前提下，主要投资于预期盈利能力较高、预期分红稳定或分红潜力大且历史分红良好的上市公司，追求稳定的股息收入和长期的资本增值。
投资策略	本集合计划遵循积极主动的投资理念，以红利股为主要投资对象，通过自下而上的方法精选个股获得股息收入和资本的长期增值。以债券和现金类资产作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的资产配置来降低组合的系统性风险。具体配置比例由管理人根据对市场走势的判断做主动调整，以求计划资产在三类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡。 主要投资策略有股票组合的构建、债券组合的构建、现金类资产投资策略和资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×75%+中债综合财富指数收益率×25%
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集合计划，高于债券型集合计划和货币市场型集合计划。

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 8号卓越时代广场（二期）北座	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	朱鹤新

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）		
	中信证券红利价值 A	中信证券红利价值 B	中信证券红利价值 C
本期已实现收益	-64,909,329.23	-1,167,950,290.27	-418,561,843.55
本期利润	-66,124,048.29	-1,213,197,788.44	-440,535,448.41
加权平均基金份额本期利润	-0.3156	-0.3217	-0.3275
本期加权平均净值利润率	-18.38%	-18.54%	-19.24%
本期基金份额净值增长率	-14.50%	-14.33%	-14.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)		
	中信证券红利价值 A	中信证券红利价值 B	中信证券红利价值 C
期末可供分配利润	80,282,045.10	2,341,020,359.85	779,706,680.55

期末可供分配基金份额利润	0.3992	0.6583	0.6186
期末基金资产净值	353,788,917.56	6,324,302,460.72	2,194,097,795.58
期末基金份额净值	1.7591	1.7784	1.7407
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)		
	中信证券红利价值 A	中信证券红利价值 B	中信证券红利价值 C
基金份额累计净值增长率	39.53%	41.06%	38.07%

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

中信证券红利价值 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	9.00%	1.31%	0.54%	0.63%	8.46%	0.68%
过去三个月	5.16%	1.51%	-2.43%	1.08%	7.59%	0.43%
过去六个月	-14.50%	1.47%	-0.80%	1.11%	-13.70%	0.36%
过去一年	-22.38%	1.33%	0.88%	0.99%	-23.26%	0.34%
自基金合同生效起至今	39.53%	1.36%	18.91%	0.91%	20.62%	0.45%

中信证券红利价值 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	9.03%	1.31%	0.54%	0.63%	8.49%	0.68%
过去三个月	5.27%	1.51%	-2.43%	1.08%	7.70%	0.43%
过去六个月	-14.33%	1.47%	-0.80%	1.11%	-13.53%	0.36%
过去一年	-22.07%	1.33%	0.88%	0.99%	-22.95%	0.34%
自基金合同生效起至今	41.06%	1.36%	18.91%	0.91%	22.15%	0.45%

中信证券红利价值 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	8.96%	1.31%	0.54%	0.63%	8.42%	0.68%
过去三个月	5.06%	1.51%	-2.43%	1.08%	7.49%	0.43%
过去六个月	-14.67%	1.47%	-0.80%	1.11%	-13.87%	0.36%
过去一年	-22.69%	1.33%	0.88%	0.99%	-23.57%	0.34%
自基金合同生效起至今	38.07%	1.36%	18.91%	0.91%	19.16%	0.45%

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

中信证券红利价值一年持有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
 (2019年10月22日至2022年6月30日)

中信证券红利价值 A



中信证券红利价值 B



中信证券红利价值 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 2022 年 06 月 30 日，旗下已有 17 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”、“中信证券品质生活混合型集合资产管理计划”、“中信证券财富优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划”、“中信证券信盈一年持有期债券型集合资产管理计划”、“中信证券增利一年定期开放债券型集合资产管理计划”、“中信证券债券增强六个月持有期债券型集合资产管理计划”、“中信证券现金增值货币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		
刘琦	本基金的基金经理；中信证券资产管理业务董事总经理、研究部负责人	2019-10-22	-	18	2006 年加入中信证券资产管理部，目前为中信证券资产管理业务董事总经理、研究部负责人。长期从事股票研究和投资，具有丰富的投资研究经验。

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

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

(3) 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定;

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

4.1.3 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
刘琦	公募基金	1	8,872,189,173.86	2019 年 10 月 22 日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	30	29,149,028,419.55	2011 年 08 月 25 日
	合计	31	38,021,217,593.41	

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

2022 年上半年，国内经济在“需求不足、供给冲击、预期转弱”的大背景下，又叠加了“美联储加息、国内疫情、俄乌战争”三重变量，经济面临的考验明显加大。特别是俄乌战争提高了全球大宗商品的价格中枢、国内疫情对制造业形成较大的冲击，不可控的变化打断了中国经济复苏的节奏，并在二季度形成低点。上半年国内财政、货币政策总体偏宽松，产业政策方面，房地产政策进一步放松，以汽车为代表的产业刺激政策不断推出，稳增长力度明显增强。随着疫情的好转，经济也处于快速的恢复过程中。

市场在国内复杂的经济局面，以及美联储加息、大宗商品价格上升的背景下，面临的压力明显加大。特别是在二季度疫情冲击下，市场恐慌情绪蔓延，导致市场大幅下跌；后在疫情恢复过程中，市场信心逐步恢复，市场扭转跌势。上半年来看，指数全面下跌，上证指数下跌 6.62%，沪深 300 指数下跌 9.22%，创业板指数下跌 15.41%。行业上，煤炭、社会服务、交通运输、建筑、银行等和通胀受益板块以及和稳增长相关的板涨幅居前，电子、传媒、计算机、军工、轻工等加工制造业行业表现落后。

上半年账户表现一般，主要是账户年初在高成长板块配置较多，导致跌幅较大；另外在反弹过程中保持了均衡的配置，导致反弹力度不足。后续，账户将进一步加强市场研判，努力优化持仓结构，提升及时应对能力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 06 月 30 日，中信证券红利价值 A 基金份额净值为 1.7591 元，本报告期份额净值增长率为-14.50%；中信证券红利价值 B 基金份额净值为 1.7784 元，本报告期份额净值增长率为-14.33%；中信证券红利价值 C 基金份额净值为 1.7407 元，本报告期份额净值增长率为-14.67%，同期业绩比较基准增长率为-0.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内宏观经济依然面临较大的复杂性，但随着疫情的缓解和稳增长政策的频出，下半年经济大概率保持较高的增速并能持续到明年上半年。管理人认为政策底和市场情绪底已现，下半年期待稳增长政策持续发力并显现效应。海外方面，美联储加息缩表正在按计划展开，俄乌冲突持续，密切关注海外是否发生衰退的风险。

当下市场面临的内外部环境依然复杂，前期市场超预期下跌带来的快速修复已接近尾声，后续市场需加大对基本面的挖掘。当下市场的估值总体偏低，这个时候策略应该积极起来。下一步，在账户操作方面，加大结构性的机会的挖掘和对股票的深度研究，在市场波动中加大逆向操作力度。

账户将继续加强各行业基本面的研究，持续扩大研究的覆盖面，深挖基本面变化，加强对新经济的研究，继续寻求具有基本面超越能力的股票。

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 2022 年上半年的投资运作，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，基金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真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，基金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 2022 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，未发现有关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：中信证券红利价值一年持有混合型集合资产管理计划

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	551,595,648.32	396,862,146.19
结算备付金		14,873,670.75	19,359,974.56
存出保证金		5,573,805.64	6,699,901.37
交易性金融资产	6.4.7.2	8,569,153,625.68	11,338,824,032.50
其中：股票投资		8,078,396,402.66	10,679,030,032.50
基金投资		-	-
债券投资		490,757,223.02	659,794,000.00
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	219,541,082.19	85,760,242.88
应收清算款		-	53,512,391.60
应收股利		-	-
应收申购款		595,862.15	480,776.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	11,781,094.40
资产总计		9,361,333,694.73	11,913,280,559.61
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		423,983,809.09	-
应付赎回款		20,865,351.75	42,002,423.27

应付管理人报酬		4,331,170.20	6,465,196.74
应付托管费		1,758,196.16	2,629,723.22
应付销售服务费		4,128,597.49	6,972,290.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		21,250,280.90	26,863,461.41
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	12,827,115.28	12,085,833.74
负债合计		489,144,520.87	97,018,928.66
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	5,017,741,405.78	5,719,277,229.69
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	3,854,447,768.08	6,096,984,401.26
净资产合计		8,872,189,173.86	11,816,261,630.95
负债和净资产总计		9,361,333,694.73	11,913,280,559.61

注：1.报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 5,017,741,405.78 份，其中 A 类基金份额净值 1.7591 元，基金份额总额 201,118,049.35 份；B 类基金份额净值 1.7784 元，基金份额总额 3,556,135,725.60 份；C 类基金份额净值 1.7407 元，基金份额总额 1,260,487,630.83 份。

2.报告截止日 2022 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值（暂估业绩报酬前）为 1.7591 元，本基金 B 类份额净值（暂估业绩报酬前）为 1.7784 元，本基金 C 类份额净值（暂估业绩报酬前）为 1.7407 元，基金份额总额为 5,017,741,405.78 份，基金资产净值（暂估业绩报酬前）8,872,189,173.86。暂估业绩报酬金额为 52,943,896.34 元，基金资产净值（暂估业绩报酬后）8,819,245,277.52 元。其中，暂估业绩报酬金额为假设本基金于本报告期末按照当日的基金份额净值（计提业绩报酬前）清算，根据基金份额持有人持有的基金份额（包括未到期份额）至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬，该金额是各基金份额持有人的暂估业绩报酬的合计，各基金份额持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

6.2 利润表

会计主体：中信证券红利价值一年持有混合型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,670,886,593.50	1,066,173,681.60
1.利息收入		2,914,141.61	24,378,788.97

其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,427,260.38	8,590,828.45
债券利息收入		-	13,993,987.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		486,881.23	1,793,973.11
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,605,846,982.82	2,878,596,685.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,660,208,384.29	2,799,439,125.40
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	5,746,144.88	2,935,217.03
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	48,615,256.59	76,222,343.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-68,435,822.09	-1,838,338,472.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	482,069.80	1,536,679.88
减：二、营业总支出		48,970,691.64	167,864,898.65
1. 管理人报酬		28,197,852.44	60,195,156.20
2. 托管费		11,450,706.29	24,595,180.68
3. 销售服务费		9,130,787.19	21,479,951.55
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		313.14	10,080,616.90
8. 其他费用	6.4.7.19	191,032.58	51,513,993.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,719,857,285.14	898,308,782.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,719,857,285.14	898,308,782.95
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,719,857,285.14	898,308,782.95

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中信证券红利价值一年持有混合型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	5,719,277,229.69	-	6,096,984,401.26	11,816,261,630.95
二、本期期初净资产 (基金净值)	5,719,277,229.69	-	6,096,984,401.26	11,816,261,630.95
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-701,535,823.91	-	-2,242,536,633.18	-2,944,072,457.09
(一)、综合收益总额	-	-	-1,719,857,285.14	-1,719,857,285.14
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-701,535,823.91	-	-522,679,348.04	-1,224,215,171.95
其中: 1.基金申购款	12,812,042.62	-	9,448,442.52	22,260,485.14
2.基金赎回款	-714,347,866.53	-	-532,127,790.56	-1,246,475,657.09
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	5,017,741,405.78	-	3,854,447,768.08	8,872,189,173.86
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	9,573,652,150.93	-	11,259,538,237.88	20,833,190,388.81
二、本期期初净资产 (基金净值)	9,573,652,150.93	-	11,259,538,237.88	20,833,190,388.81
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-1,186,795,934.88	-	-578,390,188.81	-1,765,186,123.69
(一)、综合收益总额	-	-	898,308,782.95	898,308,782.95
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-1,186,795,934.88	-	-1,476,698,971.76	-2,663,494,906.64
其中: 1.基金申购款	537,712,140.92	-	705,496,728.65	1,243,208,869.57
2.基金赎回款	-1,724,508,075.80	-	-2,182,195,700.41	-3,906,703,776.

				21
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	8,386,856,216.05	-	10,681,148,049.07	19,068,004,265.12

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

中信证券红利价值一年持有混合型集合资产管理计划(以下简称“本基金”)是由中信证券红利价值股票集合资产管理计划转型而来。中信证券红利价值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 2019 年 10 月 15 日发布《中信证券红利价值股票集合资产管理计划变更的公告》。根据公告，中信证券红利价值股票集合资产管理计划名称变更为“中信证券红利价值一年持有混合型集合资产管理计划”，中信证券红利价值股票集合资产管理计划份额转换为中信证券红利价值一年持有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 2019 年 10 月 22 日起《中信证券红利价值一年持有混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《中信证券红利价值一年持有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《中信证券红利价值一年持有混合型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票(包括通过网上申购和/或网下申购的方式参与新股配售和增发)、债券(含国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券逆回购、债券回购、同业存单、银行存款、现金，以及法律法规或中国证监会允许证券公司集合资产管理计划投资的其他投资品种。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的 50-95%。其中投资于红利股票的比例不低于

本基金非现金资产的 80%。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：中证红利指数收益率×75%+中债综合财富指数收益率×25%

本财务报表由本基金的管理人中信证券于 2022 年 8 月 30 日批准报出。

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》、《中信证券红利价值一年持有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

6.4.4.1 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，金融资产于初始确认时分类为：(1)以摊余成本计量的金融资产；(2)以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

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：以摊余成本计量的负债和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。本基金目前持有的以摊余成本计量的负债主要为卖出回购金融资产款和应付清算款等。

6.4.4.3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。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，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；以摊余成本计量的金融资产和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。

6.4.4.4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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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)。

6.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

日常经营活动中与交易相关的经济利益很可能流入本计划，相关的收入能够可靠计量且满足收入确认标准时，确认相关的收入。

存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。

买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率(当实际利率与合同利率

差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提。

债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款包含交易费用确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入，计入投资收益科目。

股票投资收益/(损失)以卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算，于除息日确认并计入投资收益。

债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账。

公允价值变动损益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期转出时计入投资收益。

其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

卖出回购金融资产款在持有期间按照实际利率法逐日计提利息支出。

6.4.4.10 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类、B 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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

交易所上市的有价证券，以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价(收盘价)估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值。

交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价。

交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值。

对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价(收盘价)估值。

首次公开发行未上市的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值

净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

国债期货等衍生品种合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》等(以下合称“新金融工具准则”)，本计划已自 2022 年 1 月 1 日起采用上述新金融工具准则。新金融工具准则下，本计划原金融工具准则的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产全部计入新金融工具准则的交易性金融资产，对本计划财务报表未产生重大影响。除因适用新金融工具准则而采用的会计政策外，本中期财务报表所采用的会计政策与编制 2021 年度财务报表所采用的会计政策一致。以下金融资产相关会计政策适用于 2021 年度：(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。(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。(3) 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。

6.4.5.2 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	551,595,648.32
等于：本金	551,457,911.96
加：应计利息	137,736.36
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	551,595,648.32

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	7,427,691,834.41	-	8,078,396,402.66	650,704,568.25
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	-	-	-	-
交易所	-	-	-	-

	市场				
	银行间市场	483,666,866.79	6,372,623.02	490,757,223.02	717,733.21
	合计	483,666,866.79	6,372,623.02	490,757,223.02	717,733.21
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		7,911,358,701.20	6,372,623.02	8,569,153,625.68	651,422,301.46

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

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 2022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	219,541,082.19	-
合计	219,541,082.19	-

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 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	18,451.72
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	12,509,156.19
其中：交易所市场	12,506,656.35
银行间市场	2,499.84
应付利息	-
其他	299,507.37
合计	12,827,115.28

6.4.7.7 实收基金

中信证券红利价值 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	216,814,309.89	216,814,309.89
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-15,696,260.54	-15,696,260.54
本期末	201,118,049.35	201,118,049.35

中信证券红利价值 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	4,041,599,042.72	4,041,599,042.72
本期申购	7,793,135.49	7,793,135.49
本期赎回（以“-”号填列）	-493,256,452.61	-493,256,452.61
本期末	3,556,135,725.60	3,556,135,725.60

中信证券红利价值 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,460,863,877.08	1,460,863,877.08
本期申购	5,018,907.13	5,018,907.13
本期赎回（以“-”号填列）	-205,395,153.38	-205,395,153.38
本期末	1,260,487,630.83	1,260,487,630.83

注：

A. 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

中信证券红利价值 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	152,893,692.86	76,380,820.11	229,274,512.97
本期利润	-64,909,329.23	-1,214,719.06	-66,124,048.29
本期基金份额交易产生的变动数	-7,702,318.53	-2,777,277.94	-10,479,596.47
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-7,702,318.53	-2,777,277.94	-10,479,596.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	80,282,045.10	72,388,823.11	152,670,868.21

中信证券红利价值 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	3,895,461,967.96	453,005,386.65	4,348,467,354.61
本期利润	-1,167,950,290.27	-45,247,498.17	-1,213,197,788.44
本期基金份额交易产生的变动数	-386,491,317.84	19,388,486.79	-367,102,831.05
其中：基金申购款	6,029,228.40	-347,574.15	5,681,654.25
基金赎回款	-392,520,546.24	19,736,060.94	-372,784,485.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,341,020,359.85	427,146,375.27	2,768,166,735.12

中信证券红利价值 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	1,351,493,892.22	167,748,641.46	1,519,242,533.68
本期利润	-418,561,843.55	-21,973,604.86	-440,535,448.41
本期基金份额交易产生的变动数	-153,225,368.12	8,128,447.60	-145,096,920.52
其中：基金申购款	3,919,498.90	-152,710.63	3,766,788.27
基金赎回款	-157,144,867.02	8,281,158.23	-148,863,708.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	779,706,680.55	153,903,484.20	933,610,164.75

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	2,185,797.99

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	193,578.08
其他	47,884.31
合计	2,427,260.38

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	17,683,463,667.53
减：卖出股票成本总额	19,298,094,627.43
减：交易费用	45,577,424.39
买卖股票差价收入	-1,660,208,384.29

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。

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	5,803,550.97
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-57,406.09
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,746,144.88

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	527,043,877.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	515,091,821.09
减：应计利息总额	12,007,302.74
减：交易费用	2,160.00
买卖债券差价收入	-57,406.09

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	48,615,256.59
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	48,615,256.59

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-70,743,573.63
——股票投资	-71,319,822.72
——债券投资	576,249.09
——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	-2,307,751.54
合计	-68,435,822.09

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	482,069.80
合计	482,069.80

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022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	5,343.00
其他	108,182.21
合计	191,032.58

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
中信证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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
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（山东）有限责任公司	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

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票成 交总额的比例
中信证券股份有限 公司	34,447,355,712.7 0	100.00%	37,914,354,344.35	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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期债券成 交总额的比例
中信证券股份有限公 司	-	-	2,311,837.03	100.00%

注：无。

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
中信证券股份有限公	-	-	7,060,000,000.0	100.00%

司			0	
---	--	--	---	--

注：无。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
中信证券股份有限公司	24,921,507.93	100.00%	12,506,656.35	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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
中信证券股份有限公司	27,395,080.20	100.00%	13,577,131.69	100.00%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金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基金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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	28,197,852.44
其中：支付销售机构的客户维护费	11,662,210.67	-

注：（1）本基金本期发生的基金应支付的固定管理费 28,197,852.44 元，支付基金管理人中信证券的管理人报酬分别按前一日 A 类基金份额、B 类基金份额和 C 类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日计提并按月支付。A 类基金份额、B 类基金份额和 C 类基金份额约定的管理费年费率分别为 1.00%、0.60% 和 0.60%。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日 A/B/C 类基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

（2）本基金本期支付的管理人业绩报酬为人民币 10,247,920.55 元。上述金额于基金份额持有人退出时提取，从退出资金中扣除。本基金在分红确认日、基金份额持有人赎回确认日和计划终止日，基金管理人将根据基金份额持有人的期间年化收益率，对 A 类份额期间年化收益率超过 8.00%

以上部分按照 20% 的比例收取管理人业绩报酬；对 B 类和 C 类份额期间年化收益率超过 6.00% 以上部分按照 20% 的比例收取管理人业绩报酬。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	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	11,450,706.29	24,595,180.68

注：支付托管人中信银行股份有限公司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 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	中信证券红利价值 A	中信证券红利价值 B	中信证券红利价值 C	合计
中信证券股份有限公司	-	-	4,742,720.91	4,742,720.91
中信银行股份有限公司	-	-	760,974.76	760,974.76
中信证券（山东）有限责任公司	-	-	1,963,439.51	1,963,439.51
中信证券华南股份有限公司	-	-	334,752.58	334,752.58
上海华夏财富投资管理有限公司	-	-	151,079.43	151,079.43
中信期货有限公司	-	-	21,967.38	21,967.38
合计	-	-	7,974,934.57	7,974,934.57
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	中信证券红利价值 A	中信证券红利价值 B	中信证券红利价值 C	合计

关联方名称		B		
中信证券股份有限公司	-	-	10,355,908.60	10,355,908.60
中信证券股份有限公司	-	-	1,432,711.47	1,432,711.47
上海华夏财富投资管理有限公司	-	-	283,932.25	283,932.25
中信证券华南股份有限公司	-	-	1,061,803.47	1,061,803.47
中信证券（山东）有限责任公司	-	-	5,224,385.57	5,224,385.57
中信期货有限公司	-	-	42,538.64	42,538.64
合计	-	-	18,401,280.00	18,401,280.00

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 类基金份额和 B 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类资产净值 × 0.80% / 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 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日		
	中信证券红利 价值A	中信证券红利 价值B	中信证券红利 价值C	中信证券红利 价值A	中信证券红利 价值B	中信证券红利 价值C
期初持有的基金份额	41,627,640.7 5	45,367,863.8 9	-	41,627,640.7 5	45,367,863.8 9	-
期间申购/买入	-	-	-	-	-	-

总份额						
期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-	-	-
期末持有的基金份额	41,627,640.75	45,367,863.89	-	41,627,640.75	45,367,863.89	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.83%	0.90%	-	0.49%	0.54%	-

6.4.10.4.2 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

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	551,595,648.32	2,185,797.99	610,068,415.54	8,267,588.13

注：本基金的银行存款由托管行中信银行股份有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2022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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022-01-06	6 个月以上	新发流通受限	55.57	30.0300	527.00	29,285.39	15,825.81	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6 个月以上	新发流通受限	39.88	31.0900	362.00	14,436.56	11,254.58	-
301120	新特电气	2022-04-11	6 个月以上	新发流通受限	13.73	15.4900	261.00	3,583.53	4,042.89	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	6 个月以上	新发流通受限	15.37	15.9900	210.00	3,227.70	3,357.90	-
301148	嘉戎技术	2022-04-14	6 个月以上	新发流通受限	38.39	23.9000	171.00	6,564.69	4,086.90	-
301151	冠龙节能	2022-03-30	6 个月以上	新发流通受限	30.82	21.4600	330.00	10,170.60	7,081.80	-
301153	中科江南	2022-05-10	6 个月以上	新发流通受限	33.68	43.9800	161.00	5,422.48	7,080.78	-
301163	宏德股份	2022-04-11	6 个月以上	新发流通受限	26.27	32.3300	99.00	2,600.73	3,200.67	-
301187	欧圣电气	2022-04-13	6 个月以上	新发流通受限	21.33	22.5400	289.00	6,164.37	6,514.06	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6 个月以上	新发流通受限	64.08	37.5200	231.00	14,802.48	8,667.12	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6 个月以上	新发流通受限	56.88	56.4200	476.00	27,074.88	26,855.92	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6 个月以上	新发流通受限	29.67	33.2800	180.00	5,340.60	5,990.40	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6 个月以上	新发流通受限	96.58	87.8200	490.00	47,322.56	43,031.80	-

30123 6	软通 动力	2022-0 3-08	6 个月 以上	新发 流通 受限	48.59	31.380 0	1,740. 00	84,540 .80	54,601 .20	-
30123 7	和顺 科技	2022-0 3-16	6 个月 以上	新发 流通 受限	56.69	41.860 0	110.00	6,235. 90	4,604. 60	-
30124 8	杰创 智能	2022-0 4-13	6 个月 以上	新发 流通 受限	39.07	29.870 0	163.00	6,368. 41	4,868. 81	-
30125 6	华融 化学	2022-0 3-14	6 个月 以上	新发 流通 受限	8.05	10.080 0	867.00	6,979. 35	8,739. 36	-
30125 8	富士 莱	2022-0 3-21	6 个月 以上	新发 流通 受限	48.30	41.680 0	126.00	6,085. 80	5,251. 68	-
30125 9	艾布 鲁	2022-0 4-18	6 个月 以上	新发 流通 受限	18.39	24.940 0	150.00	2,758. 50	3,741. 00	-
30126 3	泰恩 康	2022-0 3-22	6 个月 以上	新发 流通 受限	19.93	31.380 0	351.00	6,995. 43	11,014 .38	-
30126 6	宇邦 新材	2022-0 5-30	6 个月 以上	新发 流通 受限	26.86	47.070 0	204.00	5,479. 44	9,602. 28	-
30126 8	铭利 达	2022-0 3-29	6 个月 以上	新发 流通 受限	28.50	34.870 0	295.00	8,407. 50	10,286 .65	-
30127 9	金道 科技	2022-0 4-06	6 个月 以上	新发 流通 受限	31.20	22.810 0	144.00	4,492. 80	3,284. 64	-
30128 6	侨源 股份	2022-0 6-06	6 个月 以上	新发 流通 受限	16.91	19.790 0	288.00	4,870. 08	5,699. 52	-
30128 8	清研 环境	2022-0 4-14	6 个月 以上	新发 流通 受限	19.09	19.980 0	135.00	2,577. 15	2,697. 30	-
30129 8	东利 机械	2022-0 5-27	6 个月 以上	新发 流通 受限	12.68	20.830 0	206.00	2,612. 08	4,290. 98	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则该股票的数量和期末成本总额相应调整，新增股票的可流通日、流通受限类型和期末估值单价与原股票一致。

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 2022 年 6 月 30 日	上年末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	490,757,223.02	659,794,000.00
合计	490,757,223.02	659,794,000.00

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 2022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	551,595,648.32	-	-	-	551,595,648.32
结算备付金	14,873,670.75	-	-	-	14,873,670.75
存出保证金	5,573,805.64	-	-	-	5,573,805.64
交易性金融资产	490,757,223.02	-	-	8,078,396,402.66	8,569,153,625.68
买入返售金融资产	219,541,082.19	-	-	-	219,541,082.19
应收申购款	-	-	-	595,862.15	595,862.15
资产总计	1,282,341,429.92	-	-	8,078,992,264.81	9,361,333,694.73
负债					
应付证券清算款	-	-	-	423,983,809.09	423,983,809.09
应付赎回款	-	-	-	20,865,351.75	20,865,351.75
应付管理人报酬	-	-	-	4,331,170.20	4,331,170.20
应付托管费	-	-	-	1,758,196.16	1,758,196.16
应付销售服务费	-	-	-	4,128,597.49	4,128,597.49
应交税费	-	-	-	21,250,280.90	21,250,280.90
其他负债	-	-	-	12,827,115.28	12,827,115.28
负债总计	-	-	-	489,144,520.87	489,144,520.87
利率敏感度缺口	1,282,341,429.92	-	-	7,589,847,743.94	8,872,189,173.86
上年度末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	396,862,146.19	-	-	-	396,862,146.19
结算备付金	19,359,974.56	-	-	-	19,359,974.56
存出保证金	6,699,901.37	-	-	-	6,699,901.37
交易性金融资产	659,794,000.00	-	-	10,679,030,032.5	11,338,824,032.5

				0	2.50
买入返售金融资产	85,760,242.88	-	-	-	85,760,242.88
应收证券清算款	-	-	-	53,512,391.60	53,512,391.60
应收利息	-	-	-	11,781,094.40	11,781,094.40
应收申购款	-	-	-	480,776.11	480,776.11
资产总计	1,168,476,265.00	-	-	10,744,804,294.61	11,913,280,559.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	42,002,423.27	42,002,423.27
应付管理人报酬	-	-	-	6,465,196.74	6,465,196.74
应付托管费	-	-	-	2,629,723.22	2,629,723.22
应付销售服务费	-	-	-	6,972,290.28	6,972,290.28
应付交易费用	-	-	-	11,781,830.96	11,781,830.96
应交税费	-	-	-	26,863,461.41	26,863,461.41
其他负债	-	-	-	304,002.78	304,002.78
负债总计	-	-	-	97,018,928.66	97,018,928.66
利率敏感度缺口	1,168,476,265.00	-	-	10,647,785,365.95	11,816,261,630.95

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-432,326.01	-458,830.68
	市场利率下降 25 个基点	433,311.44	459,929.36

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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	8,078,396,402.66	91.05	10,679,030,032.50	90.38
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	490,757,223.02	5.53	659,794,000.00	5.58
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	8,569,153,625.68	96.58	11,338,824,032.50	95.96

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准下降 5%	-407,496,999.71	-492,722,929.10
	业绩比较基准上升 5%	407,496,999.71	492,722,929.10

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 2022 年 6 月 30 日
第一层次	8,078,120,729.63
第二层次	491,032,896.05
第三层次	-
合计	8,569,153,625.68

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

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	8,078,396,402.66	86.30
	其中：股票	8,078,396,402.66	86.30
2	固定收益投资	490,757,223.02	5.24
	其中：债券	490,757,223.02	5.24
	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	219,541,082.19	2.35
	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	566,469,319.07	6.05
7	其他各项资产	6,169,667.79	0.07
8	合计	9,361,333,694.73	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

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	161,372,371.70	1.82
B	采矿业	103,190,812.44	1.16
C	制造业	6,761,652,729.99	76.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,073,433.60	0.26
E	建筑业	59,293,548.84	0.67
F	批发和零售业	11,014.38	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	88,100,989.66	0.99
H	住宿和餐饮业	92,015,802.80	1.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	99,555,936.57	1.12
J	金融业	218,559,073.26	2.46
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	37,885,672.58	0.43
M	科学研究和技术服务业	302,260,796.27	3.41
N	水利、环境和公共设施管理业	7,827.90	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	88,609,724.17	1.00
R	文化、体育和娱乐业	42,806,668.50	0.48
S	综合	-	-
	合计	8,078,396,402.66	91.05

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股。

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	TCL 中环	8,839,500.00	520,558,155.00	5.87
2	601689	拓普集团	6,815,400.00	466,377,822.00	5.26
3	600519	贵州茅台	227,399.00	465,030,955.00	5.24
4	002459	晶澳科技	3,625,968.00	286,088,875.20	3.22
5	002179	中航光电	4,292,564.00	271,805,152.48	3.06
6	601799	星宇股份	1,441,778.00	246,544,038.00	2.78
7	600176	中国巨石	12,677,306.00	220,711,897.46	2.49
8	300059	东方财富	8,603,467.00	218,528,061.80	2.46
9	300750	宁德时代	408,081.00	217,915,254.00	2.46
10	002484	江海股份	9,239,228.00	215,643,581.52	2.43
11	300012	华测检测	8,927,787.00	207,213,936.27	2.34
12	000596	古井贡酒	761,291.00	190,063,911.06	2.14
13	600809	山西汾酒	555,627.00	180,467,649.60	2.03
14	000858	五粮液	882,105.00	178,123,462.65	2.01
15	600309	万华化学	1,823,930.00	176,902,970.70	1.99
16	002594	比亚迪	522,300.00	174,181,827.00	1.96
17	600150	中国船舶	8,791,880.00	166,869,882.40	1.88
18	002714	牧原股份	2,919,710.00	161,372,371.70	1.82
19	600887	伊利股份	3,960,263.00	154,252,243.85	1.74
20	600160	巨化股份	11,161,527.00	146,774,080.05	1.65
21	600703	三安光电	5,888,016.00	144,727,433.28	1.63
22	603596	伯特利	1,571,000.00	125,962,780.00	1.42
23	300568	星源材质	4,280,643.00	124,309,872.72	1.40
24	300681	英搏尔	1,779,806.00	102,819,392.62	1.16
25	600276	恒瑞医药	2,738,503.00	101,571,076.27	1.14
26	603259	药明康德	914,000.00	95,046,860.00	1.07
27	600258	首旅酒店	3,710,061.00	92,009,512.80	1.04
28	300083	创世纪	7,925,442.00	91,142,583.00	1.03
29	600031	三一重工	4,742,600.00	90,393,956.00	1.02
30	300015	爱尔眼科	1,979,221.00	88,609,724.17	1.00
31	600989	宝丰能源	6,020,826.00	88,205,100.90	0.99
32	600233	圆通速递	4,320,794.00	88,100,989.66	0.99
33	002430	杭氧股份	2,802,234.00	87,597,834.84	0.99
34	300769	德方纳米	213,260.00	87,155,096.80	0.98
35	002555	三七互娱	4,096,635.00	86,971,561.05	0.98

36	603288	海天味业	958,326.00	86,594,337.36	0.98
37	300558	贝达药业	1,322,145.00	80,386,416.00	0.91
38	300661	圣邦股份	437,253.00	79,588,791.06	0.90
39	600206	有研新材	3,756,700.00	72,654,578.00	0.82
40	601966	玲珑轮胎	2,800,700.00	71,053,759.00	0.80
41	601666	平煤股份	5,227,523.00	71,042,037.57	0.80
42	300285	国瓷材料	1,966,086.00	70,621,809.12	0.80
43	688036	传音控股	780,086.00	69,607,073.78	0.78
44	300638	广和通	2,622,511.00	69,470,316.39	0.78
45	603826	坤彩科技	1,149,397.00	67,653,507.42	0.76
46	002518	科士达	2,193,834.00	67,131,320.40	0.76
47	603959	百利科技	4,892,207.00	59,293,548.84	0.67
48	603345	安井食品	326,980.00	54,890,132.60	0.62
49	603893	瑞芯微	577,584.00	52,525,488.96	0.59
50	688700	东威科技	596,076.00	49,676,973.84	0.56
51	002262	恩华药业	3,376,743.00	45,923,704.80	0.52
52	600977	中国电影	3,722,319.00	42,806,668.50	0.48
53	002466	天齐锂业	341,300.00	42,594,240.00	0.48
54	603297	永新光学	378,700.00	42,304,577.00	0.48
55	601677	明泰铝业	1,638,260.00	38,990,588.00	0.44
56	603197	保隆科技	784,300.00	38,579,717.00	0.43
57	601888	中国中免	162,600.00	37,874,418.00	0.43
58	601238	广汽集团	2,444,245.00	37,250,293.80	0.42
59	002791	坚朗五金	282,100.00	36,594,012.00	0.41
60	688326	经纬恒润-W	245,124.00	36,047,935.44	0.41
61	000951	中国重汽	2,534,841.00	32,927,584.59	0.37
62	603979	金诚信	1,664,877.00	32,148,774.87	0.36
63	600585	海螺水泥	806,900.00	28,467,432.00	0.32
64	002920	德赛西威	164,316.00	24,318,768.00	0.27
65	688789	宏华数科	143,470.00	23,619,466.10	0.27
66	300332	天壕环境	2,060,128.00	23,073,433.60	0.26
67	688330	宏力达	221,648.00	19,059,511.52	0.21
68	002531	天顺风能	1,055,927.00	17,412,236.23	0.20
69	002078	太阳纸业	1,271,600.00	15,653,396.00	0.18
70	603217	元利科技	494,200.00	14,534,422.00	0.16
71	688777	中控技术	171,901.00	12,507,516.76	0.14
72	688707	振华新材	147,942.00	11,194,771.14	0.13
73	603916	苏博特	419,005.00	10,680,437.45	0.12
74	688617	惠泰医疗	45,513.00	9,970,988.04	0.11
75	002508	老板电器	200,000.00	7,206,000.00	0.08
76	002138	顺络电子	241,300.00	6,575,425.00	0.07
77	002460	赣锋锂业	37,600.00	5,591,120.00	0.06
78	300896	爱美客	2,300.00	1,380,023.00	0.02

79	688213	思特威-W	9,407.00	539,115.17	0.01
80	301236	软通动力	1,740.00	54,601.20	0.00
81	301219	腾远钴业	490.00	43,031.80	0.00
82	002142	宁波银行	866.00	31,011.46	0.00
83	301207	华兰疫苗	476.00	26,855.92	0.00
84	300834	星辉环材	527.00	15,825.81	0.00
85	301102	兆讯传媒	362.00	11,254.58	0.00
86	301263	泰恩康	351.00	11,014.38	0.00
87	301221	光庭信息	159.00	10,307.97	0.00
88	301268	铭利达	295.00	10,286.65	0.00
89	301266	宇邦新材	204.00	9,602.28	0.00
90	301256	华融化学	867.00	8,739.36	0.00
91	301196	唯科科技	231.00	8,667.12	0.00
92	301151	冠龙节能	330.00	7,081.80	0.00
93	301153	中科江南	161.00	7,080.78	0.00
94	603806	福斯特	100.00	6,552.00	0.00
95	301187	欧圣电气	289.00	6,514.06	0.00
96	600754	锦江酒店	100.00	6,290.00	0.00
97	301212	联盛化学	180.00	5,990.40	0.00
98	301286	侨源股份	288.00	5,699.52	0.00
99	301258	富士莱	126.00	5,251.68	0.00
100	301248	杰创智能	163.00	4,868.81	0.00
101	301237	和顺科技	110.00	4,604.60	0.00
102	301298	东利机械	206.00	4,290.98	0.00
103	301148	嘉戎技术	171.00	4,086.90	0.00
104	301120	新特电气	261.00	4,042.89	0.00
105	301259	艾布鲁	150.00	3,741.00	0.00
106	301137	哈焊华通	210.00	3,357.90	0.00
107	301279	金道科技	144.00	3,284.64	0.00
108	301163	宏德股份	99.00	3,200.67	0.00
109	301288	清研环境	135.00	2,697.30	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	660,737,006.28	5.59
2	300059	东方财富	591,495,266.31	5.01
3	002594	比亚迪	483,599,246.27	4.09
4	601899	紫金矿业	477,951,275.76	4.04

5	300750	宁德时代	476,639,240.68	4.03
6	600188	兖矿能源	474,194,424.34	4.01
7	600036	招商银行	459,716,516.62	3.89
8	600048	保利发展	422,912,268.05	3.58
9	002459	晶澳科技	413,388,389.69	3.50
10	600887	伊利股份	363,450,215.46	3.08
11	600031	三一重工	343,070,254.48	2.90
12	603259	药明康德	339,771,596.86	2.88
13	300759	康龙化成	326,100,411.82	2.76
14	601666	平煤股份	307,942,175.18	2.61
15	002475	立讯精密	307,917,838.11	2.61
16	601857	中国石油	287,945,407.78	2.44
17	000596	古井贡酒	205,717,777.53	1.74
18	600176	中国巨石	204,620,521.50	1.73
19	300274	阳光电源	200,048,409.78	1.69
20	002129	TCL 中环	197,674,209.41	1.67

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	300059	东方财富	1,261,905,424.36	10.68
2	300750	宁德时代	788,627,402.57	6.67
3	600036	招商银行	757,483,380.16	6.41
4	600188	兖矿能源	581,434,015.82	4.92
5	002594	比亚迪	473,336,142.71	4.01
6	601899	紫金矿业	434,566,697.37	3.68
7	002241	歌尔股份	406,256,949.61	3.44
8	600754	锦江酒店	388,052,694.05	3.28
9	002179	中航光电	385,960,284.07	3.27
10	600048	保利发展	373,689,247.23	3.16
11	600519	贵州茅台	345,995,181.77	2.93
12	600460	士兰微	338,269,901.64	2.86
13	600905	三峡能源	330,240,016.63	2.79
14	600989	宝丰能源	321,848,950.45	2.72
15	603259	药明康德	321,307,314.02	2.72
16	601857	中国石油	307,263,566.34	2.60
17	603799	华友钴业	285,761,405.53	2.42
18	300759	康龙化成	283,380,247.59	2.40
19	002475	立讯精密	266,344,814.57	2.25

20	300012	华测检测	251,867,585.07	2.13
21	000776	广发证券	248,249,185.52	2.10
22	000408	藏格矿业	241,451,256.41	2.04
23	002415	海康威视	237,886,197.57	2.01

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	16,763,892,045.17
卖出股票的收入（成交）总额	17,683,463,667.53

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	490,757,223.02	5.53
	其中：政策性金融债	490,757,223.02	5.53
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	490,757,223.02	5.53

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	210308	21 进出 08	2,000,000.00	202,553,863.01	2.28
2	210407	21 农发 07	1,200,000.00	122,292,328.77	1.38
3	220201	22 国开 01	1,140,000.00	115,205,776.44	1.30
4	210211	21 国开 11	300,000.00	30,588,131.51	0.34
5	220301	22 进出 01	200,000.00	20,117,123.29	0.23

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 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 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 基金投资前十名证券的发行主体未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。

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	5,573,805.64
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	595,862.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,169,667.79

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
中信证券红利价值 A	1,101	182,668.53	52,497,374.07	26.10%	148,620,675.28	73.90%
中信证券红利价	82,306	43,206.28	146,772,789.81	4.13%	3,409,362,935.	95.87%

值 B					79	
中信证券红利价值 C	33,352	37,793.46	7,366,307.43	0.58%	1,253,121,323.40	99.42%
合计	116,759	42,975.20	206,636,471.31	4.12%	4,811,104,934.47	95.88%

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	中信证券红利价值 A	4,660,581.72	2.32%
	中信证券红利价值 B	32,032,863.09	0.90%
	中信证券红利价值 C	13,662,188.61	1.08%
	合计	50,355,633.42	1.00%

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	中信证券红利价值 A	>100
	中信证券红利价值 B	0
	中信证券红利价值 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中信证券红利价值 A	>100
	中信证券红利价值 B	0
	中信证券红利价值 C	0
	合计	>100

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信证券红利价值 A	中信证券红利价值 B	中信证券红利价值 C
基金合同生效日（2019 年 10 月 22 日）基金份额总额	955,492,695.62	-	-

本报告期期初基金份额总额	216,814,309.89	4,041,599,042.72	1,460,863,877.08
本报告期基金总申购份额	-	7,793,135.49	5,018,907.13
减：本报告期基金总赎回份额	15,696,260.54	493,256,452.61	205,395,153.38
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	201,118,049.35	3,556,135,725.60	1,260,487,630.83

注：基金合同生效日：2019 年 10 月 22 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，基金管理人、基金财产、基金托管业务未涉及诉讼。

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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总额的 比例		金总量的 比例	
中信证券	4	34,447,355,712.70	100.00%	24,921,507.93	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，在近一年内无重大违规行为；
- (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；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

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	-	-	-	-	-	-

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	关于中信证券红利价值一年持有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	2022-02-23

注：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、中信证券红利价值一年持有混合型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、中信证券红利价值一年持有混合型集合资产管理计划托管协议；
- 4、中信证券红利价值一年持有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>

二〇二二年八月三十日