中信建投红利智选混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 1
1.1 重要提示 1
1.2 目录 2
§2 基金简介 4
2.1 基金基本情况 4
2.2 基金产品说明 4
2.3 基金管理人和基金托管人 4
2.4 信息披露方式 5
2.5 其他相关资料 5
§3 主要财务指标和基金净值表现 5
3.1 主要会计数据和财务指标 5
3.2 基金净值表现 6
§4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
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 9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 10
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 10
§5 托管人报告 11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 11
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 11
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 11
§6 半年度财务会计报告(未经审计) 11
6.1 资产负债表 11
6.2 利润表 13
6.3 净资产变动表 14
6.4 报表附注 15
§7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 38
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 39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 47
7.12 投资组合报告附注 47

§8 基金份额持有人信息 48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 48
8.2 盈利投资者数量占比 49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 49
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 49
§9 开放式基金份额变动 49
§10 重大事件揭示 50
10.1 基金份额持有人大会决议 50
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 50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 50
10.4 基金投资策略的改变 50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 50
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 50
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 51
10.8 其他重大事件 51
§11 影响投资者决策的其他重要信息 52
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 52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 52
§12 备查文件目录 52
12.1 备查文件目录 52
12.2 存放地点 53
12.3 查阅方式 53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投红利智选混合型证券投资基金	
基金简称	中信建投红利智选混合	
基金主代码	016774	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 10 月 25 日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
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	35,944,541.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信建投红利智选混合 A	中信建投红利智选混合 C
下属分级基金的交易代码	016774	016775
报告期末下属分级基金的份额总额	24,318,751.67 份	11,625,790.24 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	在大类资产配置过程中，本基金将对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究。通过综合考虑相关类别资产的风险收益水平及市场走势，结合经济、金融的政策调整、环境改变及其发展趋势，动态调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例，优化投资组合。 本基金重点关注红利主题股票投资机会。通过量化选股模型构建股票组合，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×70%+中证港股通高股息投资指数收益率×20%+中证综合债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信建投基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟	滕菲菲
	联系电话	010-56950806	4006800000

	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		4009-108-108	95558
传真		010-65289868	010-85230024
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 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		100010	100020
法定代表人		金强	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层

§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（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	中信建投红利智选混合 A	中信建投红利智选混合 C
本期已实现收益	-883.19	-82,678.61
本期利润	-2,369,264.28	-1,372,750.47
加权平均基金份额本期利润	-0.0937	-0.0979
本期加权平均净值利润率	-7.53%	-7.98%
本期基金份额净值增长率	-7.83%	-8.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	3,245,795.36	1,358,692.99
期末可供分配基金份额利润	0.1335	0.1169
期末基金资产净值	27,564,547.03	12,984,483.23
期末基金份额净值	1.1335	1.1169
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	13.35%	11.69%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除

相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信建投红利智选混合 A 净值表现

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
过去三个月	-9.52%	0.79%	-11.17%	0.76%	1.65%	0.03%
过去六个月	-7.83%	0.86%	-7.75%	0.83%	-0.08%	0.03%
过去一年	-6.20%	0.73%	-6.10%	0.70%	-0.10%	0.03%
过去三年	3.99%	0.88%	5.25%	0.83%	-1.26%	0.05%
自基金合同生效起至今	13.35%	0.84%	15.89%	0.83%	-2.54%	0.01%

中信建投红利智选混合 C 净值表现

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
过去三个月	-9.61%	0.79%	-11.17%	0.76%	1.56%	0.03%
过去六个月	-8.01%	0.86%	-7.75%	0.83%	-0.26%	0.03%
过去一年	-6.57%	0.73%	-6.10%	0.70%	-0.47%	0.03%
过去三年	2.76%	0.88%	5.25%	0.83%	-2.49%	0.05%
自基金合同生效起至今	11.69%	0.84%	15.89%	0.83%	-4.20%	0.01%

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





§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中信建投基金管理有限公司（以下简称“中信建投基金”）于 2013 年 9 月 9 日在北京成立，注册资本 4.5 亿元，中信建投证券股份有限公司全资控股。中信建投基金主要经营公开募集证券投资基金管理、私募资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，中信建投基金在管公募证券投资基金共 71 只。

中信建投基金以公募基金为业务本源，以专户业务为服务抓手，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，不断提升主动投资管理能力。同时，中信建投基金加强客户体系建设，积极拓展渠道，加大与国有大行、股份制银行、证券公司以及保险机构的合作力度。中信建投基金各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

中信建投基金作为基金管理公司，秉承“忠于信，健于投”，追求以稳健的投资，回馈于客户的信任；致力于经过长期努力，打造具有影响力的品牌。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王鹏	本基金的基金经理	2022-10-25	-	11 年	中国籍，哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中财期货分析师、LCM Commodities 研究员、CIBC World Market 期权交易员、中金基金管理有限公司量化投资副总经理、中金睿投投资管理有限公司量化投资副总经理、中信建投证券股份有限公司量化投资总监。2019 年 2 月加入中信建投基金管理有限公司，曾任权益投资部-指数与量化投资部负责人、总监，现任本公司指数与量化投资部基金经理，担任中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金、中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金、中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金、中信建投红利智选混合型证券投资基金、中信建投量化选股股票型证券投资基金、中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理/基金经理助理任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金运作整体合法合规。本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、其他有关法律法规及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，A 股市场整体震荡走强，但行业和个股表现呈现较强的结构性分化，科技成长风格表现突出，资金进一步向高景气、高成长及产业趋势较为明确的方向集中。活跃的市场交易和较高的个股收益离散度，为量化选股提供了较为丰富的投资机会；但与此同时，部分主流因子和热门行业的拥挤程度有所提升，强势风格持续时间拉长，传统均衡型量化组合获取超额收益的难度也有所增加，对模型适应性和组合风险管理提出了更高要求。

报告期内，本基金继续坚持量化选股投资策略，基于多因子模型，从盈利质量、成长能力、产业景气、盈利预期、估值水平及量价行为等多个维度对上市公司进行综合评估。在市场成长风格占优的环境下，模型更加注重企业盈利增长的持续性、景气趋势及盈利预期改善等信息，力争识别具有真实基本面支撑的成长机会，而非简单追逐短期高弹性和高动量品种。

与此同时，基金持续加强对行业偏离、风格暴露、个股集中度、组合流动性以及交易成本的约束，并将估值水平、交易拥挤度和因子相关性纳入组合构建过程，降低组合对单一行业、单一风格及单一因子的依赖。在保持组合分散度的基础上，力争提高成长、质量和景气等中长期有效因子的配置效率，提升组合的风险收益比。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投红利智选混合 A 基金份额净值为 1.1335 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-7.83%，同期业绩比较基准收益率为-7.75%；截至报告期末中信建投红利智选混合 C

基金份额净值为 1.1169 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.01%，同期业绩比较基准收益率为-7.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们仍相对看好成长方向的投资机会。一方面，科技创新、产业升级以及新兴产业发展仍有望形成较为持续的结构性机会，产业景气向企业盈利传导的过程可能继续为量化选股提供有效信号；另一方面，在部分热门方向估值水平和交易拥挤度已经有所提升的背景下，成长股内部预计将由前期较为普遍的估值扩张逐步转向更加重视盈利兑现和基本面质量，个股之间的分化可能进一步加剧。

基于此，本基金将继续加强成长类因子的研究和迭代，提高对盈利增速、盈利预期变化、产业景气及经营质量等基本面信号的权重，同时保持估值、质量、反转及量价等多维度信号的有效分散。组合层面将继续强化行业和风格风险约束，动态管理交易拥挤度和因子暴露，在把握成长产业趋势的同时避免过度追逐短期热门方向，力争通过更加精细化的个股选择获取稳健、可持续的超额收益。

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和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括权益投资相关部门、固定收益部、多元资产配置部、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、风险管理部、运营管理部的部门负责人。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策和执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法律及基金合同的规定。

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

本基金本报告期未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形。

本基金 2026 年 1 月 7 日至 2026 年 2 月 24 日连续二十个工作日以上基金资产净值低于 5000 万

元，本基金 2026 年 5 月 12 日至本报告期末连续二十个工作日以上基金资产净值低于 5000 万元。

§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，对中信建投红利智选混合型证券投资基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害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，中信建投基金管理有限公司在中信建投红利智选混合型证券投资基金的投资运作、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，中信建投基金管理有限公司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报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中信建投红利智选混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,947,564.19	3,412,331.18
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	38,181,362.14	46,963,902.05

其中：股票投资		38,181,362.14	46,963,902.05
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		15,457.19	6,402.80
应收申购款		27,600.14	65,937.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		42,171,983.66	50,448,573.48
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 06 月 30 日**	**上年度末 2025 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		-	-
应付赎回款		1,496,639.31	214,188.88
应付管理人报酬		45,819.24	57,379.55
应付托管费		7,636.53	9,563.27
应付销售服务费		5,448.09	6,837.72
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	67,410.23	92,054.98
负债合计		1,622,953.40	380,024.40
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	35,944,541.91	40,914,502.09
未分配利润	6.4.7.8	4,604,488.35	9,154,046.99
净资产合计		40,549,030.26	50,068,549.08
负债和净资产总计		42,171,983.66	50,448,573.48

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 35,944,541.91 份，其中中信建投红利智选混合 A 类基金份额净值 1.1335 元，基金份额 24,318,751.67 份；中信建投红利智选混合 C 类基金份额净值 1.1169 元，基金份额 11,625,790.24 份。

6.2 利润表

会计主体：中信建投红利智选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-3,324,151.71	440,770.31
1.利息收入		8,409.69	9,908.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,409.69	9,908.97
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		291,955.99	3,290,310.27
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-502,725.42	1,677,082.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	794,681.41	1,613,228.21
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-3,658,452.95	-2,955,798.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	33,935.56	96,349.63
减：二、营业总支出		417,863.04	564,694.19
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	288,660.50	386,613.27
2.托管费	6.4.10.2.2	48,110.07	64,435.57
3.销售服务费	6.4.10.2.3	33,989.85	58,958.93
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.17	47,102.62	54,686.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,742,014.75	-123,923.88
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,742,014.75	-123,923.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,742,014.75	-123,923.88

6.3 净资产变动表

会计主体：中信建投红利智选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	40,914,502.09	9,154,046.99	50,068,549.08
二、本期期初净资产	40,914,502.09	9,154,046.99	50,068,549.08
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,969,960.18	-4,549,558.64	-9,519,518.82
（一）、综合收益总额	-	-3,742,014.75	-3,742,014.75
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-4,969,960.18	-807,543.89	-5,777,504.07
其中：1.基金申购款	21,253,997.48	5,321,321.96	26,575,319.44
2.基金赎回款	-26,223,957.66	-6,128,865.85	-32,352,823.51
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	35,944,541.91	4,604,488.35	40,549,030.26
项 目	**上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	59,374,887.76	12,079,007.34	71,453,895.10
二、本期期初净资产	59,374,887.76	12,079,007.34	71,453,895.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,457,838.13	-2,178,907.39	-12,636,745.52
（一）、综合收益总额	-	-123,923.88	-123,923.88
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-10,457,838.13	-2,054,983.51	-12,512,821.64
其中：1.基金申购款	41,986,781.01	7,024,244.89	49,011,025.90
2.基金赎回款	-52,444,619.14	-9,079,228.40	-61,523,847.54
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-

四、本期期末净资产	48,917,049.63	9,900,099.95	58,817,149.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

金强	张欣宇	谭保民
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信建投红利智选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可〔2022〕2076 号《关于准予中信建投红利智选混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投红利智选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 260,290,325.13 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0887 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中信建投红利智选混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 10 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 260,365,619.42 份基金份额，其中认购资金利息折合 75,294.29 份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中信建投红利智选混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投红利智选混合型证券投资基金基金合同》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，包括国内依法发行上市的股票（含创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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。本基金股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 60%-95%（投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%），投资于红利主题相关股票占非现金基金资产的比例不低于 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政

府债券的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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证红利指数收益率×70%+中证港股通高股息投资指数收益率×20%+中证综合债指数收益率×10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号-定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号-年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日期间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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产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 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时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、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；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大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，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，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）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。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（4）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（5）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（6）公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额形成的应计入当期损益的利得或损失；

（7）其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金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予以确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

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）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）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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

（1）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕140 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》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；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“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，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，

自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132 号《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2014〕81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2016〕127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	1,627,557.21
等于：本金	1,627,439.48

加：应计利息	117.73
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	2,320,006.98
等于：本金	2,319,815.62
加：应计利息	191.36
减：坏账准备	-
合计	3,947,564.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		42,701,925.87	-	38,181,362.14	-4,520,563.73
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		42,701,925.87	-	38,181,362.14	-4,520,563.73

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

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	19.37
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	57,622.86
其他应付	9,768.00
合计	67,410.23

6.4.7.7 实收基金

中信建投红利智选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,084,409.20	25,084,409.20
本期申购	10,717,090.85	10,717,090.85
本期赎回（以“-”号填列）	-11,482,748.38	-11,482,748.38
本期末	24,318,751.67	24,318,751.67

中信建投红利智选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,830,092.89	15,830,092.89
本期申购	10,536,906.63	10,536,906.63
本期赎回（以“-”号填列）	-14,741,209.28	-14,741,209.28
本期末	11,625,790.24	11,625,790.24

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

6.4.7.8 未分配利润

中信建投红利智选混合 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	8,100,080.88	-2,335,895.10	5,764,185.78
本期期初	8,100,080.88	-2,335,895.10	5,764,185.78
本期利润	-883.19	-2,368,381.09	-2,369,264.28
本期基金份额交易产生的变动数	-307,961.84	158,835.70	-149,126.14
其中：基金申购款	3,599,667.35	-819,148.75	2,780,518.60
基金赎回款	-3,907,629.19	977,984.45	-2,929,644.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,791,235.85	-4,545,440.49	3,245,795.36

中信建投红利智选混合 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	4,852,805.01	-1,462,943.80	3,389,861.21
本期期初	4,852,805.01	-1,462,943.80	3,389,861.21
本期利润	-82,678.61	-1,290,071.86	-1,372,750.47
本期基金份额交易产生的变动数	-1,262,585.01	604,167.26	-658,417.75
其中：基金申购款	3,339,674.76	-798,871.40	2,540,803.36
基金赎回款	-4,602,259.77	1,403,038.66	-3,199,221.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,507,541.39	-2,148,848.40	1,358,692.99

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	4,012.41
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,347.78
结算备付金利息收入	-
其他	49.50
合计	8,409.69

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	147,390,834.34
减：卖出股票成本总额	147,670,726.05

减：交易费用	222,833.71
买卖股票差价收入	-502,725.42

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	794,681.41
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	794,681.41

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1.交易性金融资产	-3,658,452.95
——股票投资	-3,658,452.95
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-3,658,452.95

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	33,935.56
合计	33,935.56

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额中归入基金资产的比例按持有期间递减且不低于 25%。

6.4.7.16 信用减值损失

无。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	5,951.28
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,403.01
证券组合费	76.75
合计	47,102.62

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信建投基金管理有限公司	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
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

中信建投期货有限公司	与基金管理人同一控股股东、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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	195,345,301.21	67.37%	234,315,359.80	67.89%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	86,828.86	67.37%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	103,931.71	67.85%	0.00	0.00%

注：1、上述佣金按本基金的基金管理人与对方协商确定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司代收的证管费和经手费的净额列示。

2、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。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日

起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	288,660.50	386,613.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	127,108.75	178,001.48
应支付基金管理人的净管理费	161,551.75	208,611.79

注：支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	48,110.07	64,435.57

注：支付基金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 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%/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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投红利智选混合 A	中信建投红利智选混合 C	合计
中信建投证券股份有限公司	-	16,554.07	16,554.07
中信银行股份有限公司	-	3,190.58	3,190.58
合计	-	19,744.65	19,744.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	中信建投红利智选混合 A	中信建投红利智选混合 C	合计
中信银行股份有限公司	-	636.20	636.20
中信建投证券股份有限公司	-	35,266.29	35,266.29
合计	-	35,902.49	35,902.49

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中信建投基金管理有限公司，再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日 C 类的基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

中信建投红利智选混合 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	3,956,783.28	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	3,956,783.28	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.2705%	-

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 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	1,627,557.21	4,012.41	710,196.45	5,378.05
中信建投证券股份有限公司	1,039,165.94	1,957.49	1,945,819.87	2,661.77

注：本基金托管账户的存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。本基金证券资金账户的存款由中信建投证券股份有限公司保管，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

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 06 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。

6.4.13 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信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了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。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、风险管理部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去

评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他拥有相关资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场等场外市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风

险一方面来自于基金份额持有人于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12（如有）。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,947,564.19	-	-	-	3,947,564.19
交易性金融资产	-	-	-	38,181,362.14	38,181,362.14
应收股利	-	-	-	15,457.19	15,457.19
应收申购款	-	-	-	27,600.14	27,600.14
资产总计	3,947,564.19	-	-	38,224,419.47	42,171,983.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,496,639.31	1,496,639.31
应付管理人报酬	-	-	-	45,819.24	45,819.24
应付托管费	-	-	-	7,636.53	7,636.53
应付销售服务费	-	-	-	5,448.09	5,448.09
其他负债	-	-	-	67,410.23	67,410.23
负债总计	-	-	-	1,622,953.40	1,622,953.40
利率敏感度缺口	3,947,564.19	-	-	36,601,466.07	40,549,030.26
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,412,331.18	-	-	-	3,412,331.18
交易性金融资产	-	-	-	46,963,902.05	46,963,902.05
应收股利	-	-	-	6,402.80	6,402.80
应收申购款	-	-	-	65,937.45	65,937.45
资产总计	3,412,331.18	-	-	47,036,242.30	50,448,573.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	214,188.88	214,188.88
应付管理人报酬	-	-	-	57,379.55	57,379.55
应付托管费	-	-	-	9,563.27	9,563.27
应付销售服务费	-	-	-	6,837.72	6,837.72
其他负债	-	-	-	92,054.98	92,054.98
负债总计	-	-	-	380,024.40	380,024.40

利率敏感度缺口	3,412,331.18	-	-	46,656,217.90	50,068,549.08

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末及上年度末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例并不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,610,356.84	-	1,610,356.84
应收股利	-	15,457.19	-	15,457.19
资产合计	-	1,625,814.03	-	1,625,814.03
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,625,814.03	-	1,625,814.03
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	2,885,968.55	-	2,885,968.55
应收股利	-	6,402.80	-	6,402.80
资产合计	-	2,892,371.35	-	2,892,371.35
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	2,892,371.35	-	2,892,371.35

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	81,290.70	144,618.57
	港币相对人民币贬值 5%	-81,290.70	-144,618.57

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日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对基金进行风险度量，及时可靠地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 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 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	38,181,362.14	94.16	46,963,902.05	93.80
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	38,181,362.14	94.16	46,963,902.05	93.80

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	1,853,164.21	2,473,789.06
	业绩比较基准下降 5%	-1,853,164.21	-2,473,789.06

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	38,181,362.14	46,963,902.05
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	38,181,362.14	46,963,902.05

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3

本财务报表已于 2026 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§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	38,181,362.14	90.54
	其中：股票	38,181,362.14	90.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,947,564.19	9.36
8	其他各项资产	43,057.33	0.10
9	合计	42,171,983.66	100.00

注：本基金本报告期末通过深港通机制投资香港股票的公允价值为 1,610,356.84 元，占基金资产净值比例为 3.97%。

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	119,240.00	0.29
B	采矿业	3,976,478.00	9.81
C	制造业	10,482,085.70	25.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,959,327.00	4.83
E	建筑业	1,131,820.00	2.79
F	批发和零售业	818,037.00	2.02
G	交通运输、仓储和邮政业	4,443,141.00	10.96
H	住宿和餐饮业	156,888.00	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	899,773.00	2.22
J	金融业	10,256,931.20	25.30
K	房地产业	808,693.00	1.99
L	租赁和商务服务业	428,761.00	1.06
M	科学研究和技术服务业	255,806.40	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	148,266.00	0.37

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	685,758.00	1.69
S	综合	-	-
	合计	36,571,005.30	90.19

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	90,094.69	0.22
日常消费品	57,602.24	0.14
能源	339,889.67	0.84
金融	469,208.08	1.16
工业	447,029.66	1.10
通讯业务	108,594.80	0.27
公用事业	51,036.00	0.13
房地产	46,901.70	0.12
合计	1,610,356.84	3.97

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	601939	建设银行	63,300	609,579.00	1.50
1	00939	建设银行	9,000	63,082.79	0.16
2	600256	广汇能源	122,200	603,668.00	1.49
3	601658	邮储银行	117,800	580,754.00	1.43
4	601088	中国神华	12,600	491,904.00	1.21
4	01088	中国神华	2,500	87,115.57	0.21
5	600919	江苏银行	52,200	562,716.00	1.39
6	600019	宝钢股份	93,100	505,533.00	1.25
7	601225	陕西煤业	23,600	480,260.00	1.18
8	601988	中国银行	83,100	475,332.00	1.17
9	601728	中国电信	89,100	462,429.00	1.14
10	601009	南京银行	46,700	461,863.00	1.14
11	603565	中谷物流	45,300	444,393.00	1.10
12	600782	新钢股份	175,900	436,232.00	1.08
13	601398	工商银行	52,700	372,589.00	0.92
13	01398	工商银行	11,000	61,432.54	0.15
14	601668	中国建筑	99,300	430,962.00	1.06
15	601229	上海银行	48,300	419,244.00	1.03

16	600282	南钢股份	90,800	416,772.00	1.03
17	601919	中远海控	23,300	308,958.00	0.76
17	01919	中远海控	9,500	107,348.44	0.26
18	601598	中国外运	83,400	413,664.00	1.02
19	000001	平安银行	40,800	410,040.00	1.01
20	601898	中煤能源	28,700	349,566.00	0.86
20	01898	中煤能源	7,000	59,886.52	0.15
21	600887	伊利股份	17,000	407,320.00	1.00
22	601328	交通银行	63,100	405,733.00	1.00
23	600023	浙能电力	76,800	403,968.00	1.00
24	601077	渝农商行	64,300	392,873.00	0.97
25	601318	中国平安	7,800	372,372.00	0.92
26	600153	建发股份	46,600	369,538.00	0.91
27	601838	成都银行	20,800	368,160.00	0.91
28	000923	河钢资源	28,300	351,203.00	0.87
29	601169	北京银行	70,200	343,980.00	0.85
30	600219	南山铝业	85,000	339,150.00	0.84
31	600050	中国联通	82,900	331,600.00	0.82
32	601006	大秦铁路	70,900	326,849.00	0.81
33	600015	华夏银行	50,100	320,139.00	0.79
34	000932	华菱钢铁	92,100	319,587.00	0.79
35	601665	齐鲁银行	54,100	312,157.00	0.77
36	600000	浦发银行	35,300	303,933.00	0.75
37	600926	杭州银行	20,800	300,560.00	0.74
38	600011	华能国际	37,300	283,107.00	0.70
39	600461	洪城环境	31,000	280,860.00	0.69
40	600566	济川药业	12,500	277,375.00	0.68
41	601857	中国石油	23,100	200,508.00	0.49
41	00857	中国石油股份	10,000	73,653.04	0.18
42	601825	沪农商行	35,800	268,142.00	0.66
43	600348	华阳股份	35,000	267,750.00	0.66
44	000429	粤高速 A	19,600	267,540.00	0.66
45	601107	四川成渝	54,100	264,008.00	0.65
46	601766	中国中车	50,600	263,120.00	0.65
47	601567	三星电气	17,600	262,944.00	0.65
48	601156	东航物流	15,700	253,084.00	0.62
49	600704	物产中大	53,500	252,520.00	0.62
50	600096	云天化	8,200	249,280.00	0.61
51	000157	中联重科	35,700	248,829.00	0.61
52	601128	常熟银行	42,110	245,080.20	0.60
53	600866	星湖科技	55,400	243,206.00	0.60
54	600489	中金黄金	13,300	240,065.00	0.59
55	600064	南京高科	33,200	236,716.00	0.58

56	601997	贵阳银行	45,100	231,363.00	0.57
57	600177	雅戈尔	30,300	228,159.00	0.56
58	600970	中材国际	31,900	227,447.00	0.56
59	601288	农业银行	29,000	176,030.00	0.43
59	01288	农业银行	11,000	51,018.63	0.13
60	601390	中国中铁	54,100	225,597.00	0.56
61	600999	招商证券	10,600	223,660.00	0.55
62	600901	江苏金租	37,400	215,050.00	0.53
63	600757	长江传媒	29,400	214,914.00	0.53
64	600188	兖矿能源	12,000	213,240.00	0.53
65	601577	长沙银行	24,400	212,524.00	0.52
66	000333	美的集团	2,800	211,484.00	0.52
67	605599	菜百股份	15,400	210,980.00	0.52
68	603167	渤海轮渡	24,200	207,394.00	0.51
69	601018	宁波港	65,800	207,270.00	0.51
70	600642	申能股份	23,700	206,901.00	0.51
71	601336	新华保险	3,400	202,844.00	0.50
72	600018	上港集团	41,900	197,768.00	0.49
73	601816	京沪高铁	43,400	196,602.00	0.48
74	002948	青岛银行	38,400	195,072.00	0.48
75	600350	山东高速	17,400	193,662.00	0.48
76	600795	国电电力	40,800	190,536.00	0.47
77	003816	中国广核	48,500	189,635.00	0.47
78	601518	吉林高速	67,500	189,000.00	0.47
79	600325	华发股份	81,700	188,727.00	0.47
80	000708	中信特钢	14,600	184,252.00	0.45
81	000897	津滨发展	110,800	183,928.00	0.45
82	603766	隆鑫通用	15,400	183,722.00	0.45
83	601000	唐山港	43,600	180,940.00	0.45
84	002966	苏州银行	25,900	180,264.00	0.44
85	601992	金隅集团	131,100	178,296.00	0.44
86	601333	广深铁路	64,400	177,100.00	0.44
87	601319	中国人保	26,100	176,436.00	0.44
88	600690	海尔智家	8,600	175,526.00	0.43
89	601555	东吴证券	21,800	172,656.00	0.43
90	600428	中远海特	22,000	171,820.00	0.42
91	000719	中原传媒	14,800	169,164.00	0.42
92	601918	新集能源	19,100	164,069.00	0.40
93	601916	浙商银行	61,000	160,430.00	0.40
94	601117	中国化学	21,800	160,230.00	0.40
95	001979	招商蛇口	24,800	159,464.00	0.39
96	601298	青岛港	19,700	158,585.00	0.39
97	601166	兴业银行	9,400	155,664.00	0.38

98	600531	豫光金铅	10,500	154,980.00	0.38
99	600750	华润江中	7,000	154,490.00	0.38
100	601985	中国核电	16,800	151,704.00	0.37
101	000672	上峰材料	6,400	151,552.00	0.37
102	601601	中国太保	5,300	151,156.00	0.37
103	600352	浙江龙盛	12,200	147,742.00	0.36
104	605389	长龄液压	1,500	144,000.00	0.36
105	301238	瑞泰新材	5,500	134,200.00	0.33
106	002283	天润工业	13,300	128,345.00	0.32
107	002415	海康威视	3,700	126,540.00	0.31
108	301177	迪阿股份	4,500	124,065.00	0.31
109	301087	可孚医疗	2,600	123,890.00	0.31
110	601921	浙版传媒	18,500	123,765.00	0.31
111	603659	璞泰来	4,200	121,506.00	0.30
112	600598	北大荒	11,000	119,240.00	0.29
113	601963	重庆银行	11,800	118,944.00	0.29
114	601880	辽港股份	85,600	118,128.00	0.29
115	688378	奥来德	1,868	115,816.00	0.29
116	301419	阿莱德	2,200	113,498.00	0.28
117	603816	顾家家居	5,000	111,800.00	0.28
118	600116	三峡水利	19,900	111,440.00	0.27
119	300957	贝泰妮	3,500	110,285.00	0.27
120	601339	百隆东方	16,100	108,997.00	0.27
121	002111	威海广泰	12,100	108,900.00	0.27
122	603269	海鸥股份	6,580	108,372.60	0.27
123	002328	新朋股份	14,700	107,898.00	0.27
124	00316	东方海外国际	1,000	105,963.10	0.26
125	301047	义翘神州	1,640	105,878.40	0.26
126	301299	卓创资讯	2,400	105,744.00	0.26
127	600754	锦江酒店	5,800	104,342.00	0.26
128	002236	大华股份	6,300	103,887.00	0.26
129	601666	平煤股份	14,400	102,960.00	0.25
130	300802	矩子科技	4,300	99,674.00	0.25
131	605018	长华集团	6,500	96,915.00	0.24
132	600985	淮北矿业	6,800	95,540.00	0.24
133	002271	东方雨虹	8,000	94,960.00	0.23
134	002128	电投能源	4,000	92,480.00	0.23
135	002293	罗莱生活	9,300	91,977.00	0.23
136	301365	矩阵股份	2,400	90,984.00	0.22
137	002233	塔牌集团	13,000	90,610.00	0.22
138	301665	泰禾股份	4,300	90,128.00	0.22
139	000408	藏格矿业	1,300	90,116.00	0.22
140	000062	深圳华强	2,800	89,096.00	0.22

141	600398	海澜之家	16,900	88,387.00	0.22
142	600039	四川路桥	11,200	87,584.00	0.22
143	002925	盈趣科技	3,500	86,310.00	0.21
144	603195	公牛集团	2,200	86,130.00	0.21
145	002034	旺能环境	5,600	84,840.00	0.21
146	603897	长城科技	2,600	84,396.00	0.21
147	601168	西部矿业	3,100	84,134.00	0.21
148	600273	嘉化能源	12,700	82,804.00	0.20
149	01308	海丰国际	3,000	81,765.30	0.20
150	300099	尤洛卡	12,800	80,896.00	0.20
151	301109	军信股份	6,300	78,498.00	0.19
152	000895	双汇发展	3,500	78,400.00	0.19
153	601001	晋控煤业	4,500	78,255.00	0.19
154	002511	中顺洁柔	11,300	75,145.00	0.19
155	603948	建业股份	3,100	74,710.00	0.18
156	02388	中银香港	2,000	73,618.30	0.18
157	601216	君正集团	16,400	73,144.00	0.18
158	603350	安乃达	2,300	72,565.00	0.18
159	000651	格力电器	1,900	71,250.00	0.18
160	00883	中国海洋石油	4,000	70,595.74	0.17
161	600737	中粮糖业	5,700	70,281.00	0.17
162	000933	神火股份	3,300	69,960.00	0.17
163	601187	厦门银行	10,100	68,983.00	0.17
164	603558	健盛集团	6,200	68,758.00	0.17
165	03808	中国重汽	2,000	66,947.83	0.17
166	00941	中国移动	1,000	66,140.08	0.16
167	601083	锦江航运	6,600	65,604.00	0.16
168	600817	宇通重工	7,400	65,120.00	0.16
169	01988	民生银行	23,500	64,090.30	0.16
170	002572	索菲亚	8,500	62,050.00	0.15
171	600551	时代出版	9,300	61,845.00	0.15
172	300127	银河磁体	2,200	61,490.00	0.15
173	000983	山西焦煤	10,500	60,900.00	0.15
174	03360	远东宏信	13,000	60,407.65	0.15
175	002818	富森美	5,700	59,223.00	0.15
176	301230	泓博医药	1,600	58,944.00	0.15
177	601098	中南传媒	5,900	58,056.00	0.14
178	601928	凤凰传媒	6,600	58,014.00	0.14
179	002563	森马服饰	11,500	57,960.00	0.14
180	603566	普莱柯	5,900	57,761.00	0.14
181	002441	众业达	7,400	57,720.00	0.14
182	00288	万洲国际	8,000	57,602.24	0.14
183	001299	美能能源	5,600	56,336.00	0.14

184	600741	华域汽车	3,600	55,872.00	0.14
185	301019	宁波色母	3,100	55,273.00	0.14
186	600346	恒力石化	3,100	54,901.00	0.14
187	600295	鄂尔多斯	5,100	54,672.00	0.13
188	603006	联明股份	3,800	54,150.00	0.13
189	00551	裕元集团	5,000	53,198.69	0.13
190	601007	金陵饭店	8,600	52,546.00	0.13
191	688569	铁科轨道	3,234	52,229.10	0.13
192	00371	北控水务集团	26,000	51,036.00	0.13
193	600787	中储股份	12,200	50,996.00	0.13
194	02328	中国财险	4,000	49,750.54	0.12
195	00386	中国石油化工股份	14,000	48,638.80	0.12
196	01908	建发国际集团	4,000	46,901.70	0.12
197	06818	中国光大银行	18,000	45,807.33	0.11
198	600729	重百集团	2,400	45,072.00	0.11
199	002763	汇洁股份	6,600	44,814.00	0.11
200	301219	腾远钴业	810	44,388.00	0.11
201	300219	鸿利智汇	4,200	43,806.00	0.11
202	00257	光大环境	11,000	43,566.47	0.11
203	603515	欧普照明	2,600	42,484.00	0.10
204	00762	中国联通	8,000	42,454.72	0.10
205	002887	绿茵生态	4,000	41,880.00	0.10
206	01800	中国交通建设	13,000	41,438.52	0.10
207	600546	山煤国际	3,700	40,441.00	0.10
208	600351	亚宝药业	7,000	40,250.00	0.10
209	600007	中国国贸	2,100	39,858.00	0.10
210	600908	无锡银行	7,700	39,116.00	0.10
211	301279	金道科技	1,800	39,114.00	0.10
212	600971	恒源煤电	5,600	38,640.00	0.10
213	002228	合兴包装	12,600	37,044.00	0.09
214	06862	海底捞	4,000	36,896.00	0.09
215	603788	宁波高发	2,600	35,880.00	0.09
216	301156	美农生物	3,300	35,871.00	0.09
217	000900	现代投资	9,600	33,216.00	0.08
218	300932	三友联众	3,100	32,860.00	0.08
219	600030	中信证券	1,100	31,603.00	0.08
220	002737	葵花药业	2,500	28,025.00	0.07
221	003027	同兴科技	1,600	27,888.00	0.07
222	300837	浙矿股份	1,100	26,136.00	0.06
223	600232	金鹰股份	3,600	22,680.00	0.06
224	301329	信音电子	900	21,861.00	0.05
225	000937	冀中能源	5,250	20,895.00	0.05

226	605266	健之佳	1,400	20,496.00	0.05
227	002839	张家港行	5,100	19,890.00	0.05
228	002999	天禾股份	3,400	18,088.00	0.04
229	603787	新日股份	1,900	17,271.00	0.04
230	603967	中创物流	1,600	16,560.00	0.04
231	300823	建科智能	900	13,122.00	0.03

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	603588	高能环境	2,800,329.00	5.59
2	600007	中国国贸	2,072,589.00	4.14
3	600096	云天化	1,966,876.00	3.93
4	600256	广汇能源	1,706,577.94	3.41
5	601919	中远海控	1,485,131.00	2.97
6	601872	招商轮船	1,480,920.00	2.96
7	600282	南钢股份	1,474,037.00	2.94
8	000900	现代投资	1,471,549.00	2.94
9	603730	岱美股份	1,434,038.00	2.86
10	600141	兴发集团	1,421,287.00	2.84
11	000923	河钢资源	1,390,485.00	2.78
12	601168	西部矿业	1,359,447.00	2.72
13	601728	中国电信	1,336,326.00	2.67
14	601225	陕西煤业	1,332,536.00	2.66
15	601916	浙商银行	1,324,770.00	2.65
16	601988	中国银行	1,317,064.00	2.63
17	600894	广日股份	1,308,686.00	2.61
18	600352	浙江龙盛	1,202,459.00	2.40
19	600011	华能国际	1,193,523.00	2.38
20	603565	中谷物流	1,186,998.00	2.37
21	600566	济川药业	1,158,138.00	2.31
22	600031	三一重工	1,133,394.00	2.26
23	603071	物产环能	1,099,707.00	2.20
24	601555	东吴证券	1,076,125.00	2.15
25	600153	建发股份	1,071,960.00	2.14
26	601336	新华保险	1,057,983.00	2.11
27	601601	中国太保	1,045,405.00	2.09
28	000937	冀中能源	1,041,412.00	2.08
29	601717	中创智领	1,016,951.00	2.03

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	603588	高能环境	2,915,669.00	5.82
2	600007	中国国贸	2,001,247.00	4.00
3	601872	招商轮船	1,827,344.00	3.65
4	000900	现代投资	1,664,143.00	3.32
5	600737	中粮糖业	1,582,609.00	3.16
6	600096	云天化	1,565,620.00	3.13
7	601857	中国石油	1,514,299.00	3.02
7	00857	中国石油股份	44,210.24	0.09
8	603730	岱美股份	1,440,634.00	2.88
9	601000	唐山港	1,422,337.00	2.84
10	601988	中国银行	1,418,526.00	2.83
11	600141	兴发集团	1,350,949.00	2.70
12	600352	浙江龙盛	1,337,537.00	2.67
13	601168	西部矿业	1,321,233.00	2.64
14	601919	中远海控	1,221,509.00	2.44
14	01919	中远海控	98,149.59	0.20
15	600894	广日股份	1,227,273.00	2.45
16	000895	双汇发展	1,188,472.00	2.37
17	600642	申能股份	1,156,852.00	2.31
18	601916	浙商银行	1,150,317.00	2.30
19	600008	首创环保	1,140,873.00	2.28
20	688009	中国通号	1,110,273.90	2.22
21	600256	广汇能源	1,091,640.00	2.18
22	603071	物产环能	1,091,438.00	2.18
23	600031	三一重工	1,055,436.00	2.11
24	600350	山东高速	1,041,367.00	2.08
25	601318	中国平安	1,026,515.00	2.05
26	000937	冀中能源	1,024,460.00	2.05
27	600863	华能蒙电	1,011,635.00	2.02

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	142,546,639.09
卖出股票收入（成交）总额	147,390,834.34

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

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

本基金在进行国债期货投资时，根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对基本面和资金面的分析，对国债市场走势做出判断，以作为确定国债期货的头寸方向和额度的依据。基金管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚，中国邮政储蓄银行股份有限公司、中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中国神华能源股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到鄂尔多斯市应急管理局的处罚，南京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本报告期内，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

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	应收清算款	-
3	应收股利	15,457.19
4	应收利息	-
5	应收申购款	27,600.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,057.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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
中信建投	915	26,577.87	5,307,560.33	21.8250%	19,011,191.34	78.1750%

红利智选混合 A						
中信建投红利智选混合 C	2,737	4,247.64	1,631,720.65	14.0354%	9,994,069.59	85.9646%
合计	3,630	9,902.08	6,939,280.98	19.3055%	29,005,260.93	80.6945%

注：持有人户数合计数少于各分项之和，系部分基金持有人持有多个份额类别基金所致。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	27.2507%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信建投红利智选混合 A	176,854.66	0.7272%
	中信建投红利智选混合 C	239.20	0.0021%
	合计	177,093.86	0.4927%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信建投红利智选混合 A	0~10
	中信建投红利智选混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投红利智选混合 A	10~50
	中信建投红利智选混合 C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投红利智选混合 A	中信建投红利智选混合 C
基金合同生效日（2022 年 10 月 25 日）基金份额总额	196,973,680.23	63,391,939.19
本报告期期初基金份额总额	25,084,409.20	15,830,092.89
本报告期基金总申购份额	10,717,090.85	10,536,906.63
减：本报告期基金总赎回份额	11,482,748.38	14,741,209.28
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	24,318,751.67	11,625,790.24

§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，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2026 年 4 月 23 日，金强先生不再担任基金管理人总经理、副董事长，转任基金管理人董事长（法定代表人），黄凌先生不再担任基金管理人董事长（法定代表人）。自 2026 年 4 月 23 日起，金强先生代为履行基金管理人总经理职务。

2026 年 6 月，经基金托管人中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金托管业务无影响。

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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人未受调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券股份有限公司	3	195,345,301.21	67.37%	86,828.86	67.37%	-
东北证券股份有限公司	3	85,135,480.25	29.36%	38,002.80	29.48%	-
华西证券股份有限公司	3	9,456,691.97	3.26%	4,059.19	3.15%	-

注：1、本基金的证券交易结算模式为券商结算模式，表中的证券交易成交金额及应支付的佣金等数据，为委托证券公司办理证券投资及佣金支付情况。

2、本报告期内，本基金办理证券投资委托的证券公司未发生变更。

3、根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》及《中信建投基金管理有限公司公募基金证券交易费用管理办法》，基金管理人选择证券公司参与证券交易的标准和程序如下：

（1）选择证券公司参与证券交易的标准

基金管理人根据自身合规风控能力、信息系统建设水平、运营及交易服务能力、研究服务能力、产品管理规模等情况，审慎选择财务状况良好，经营稳健规范，系统运行安全，合规风控能力、运营及交易服务能力、研究服务能力较强的证券公司参与证券交易。

（2）选择证券公司参与证券交易的程序

基金管理人指定专人负责参与证券交易的证券公司的准入评估，并根据评估结果完成与证券公司的协议签订及交易佣金费率的确定等工作。基金管理人建立了“证券研究报告质量评分机制”“证券综合研究服务评分体系”等，每季度组织公募投研部门完成对已合作证券公司的研究服务打分评价，评价结果是确定/调整证券公司股票交易成交金额及佣金比例限制的参考。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2026-01-22
2	中信建投红利智选混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	规定网站	2026-01-22
3	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金	规定报刊	2026-03-31

	2025 年年度报告提示性公告		
4	中信建投红利智选混合型证券投资基金 2025 年年度报告	规定网站	2026-03-31
5	中信建投基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况公告（2025 年度）	规定网站	2026-03-31
6	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026-04-22
7	中信建投红利智选混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	规定网站	2026-04-22
8	中信建投基金管理有限公司董事长（法定代表人）、高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2026-04-25
9	中信建投红利智选混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	规定网站、规定报刊	2026-06-25
10	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	规定网站、规定报刊	2026-06-27
11	中信建投红利智选混合型证券投资基金基金合同	规定网站	2026-06-27
12	中信建投红利智选混合型证券投资基金托管协议	规定网站	2026-06-27

§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

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予基金注册的文件；

2、《中信建投红利智选混合型证券投资基金基金合同》；

3、《中信建投红利智选混合型证券投资基金托管协议》；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日