

建信智汇优选一年持有期混合型管理人中
管理人（MOM）证券投资基金
2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信智汇优选一年持有期混合（MOM）
基金主代码	011189
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 26 日
报告期末基金份额总额	2,060,773,401.73 份
投资目标	本基金通过优选投资顾问为特定资产单元提供投资建议和灵活的投资策略，捕捉市场中的投资机会，并且采用有效的风险管理措施，降低波动风险的同时，争取获取稳定的收益。
投资策略	<p>本基金为混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金，将通过优选投资顾问为特定资产单元提供投资建议。本基金的投资策略主要分为四个层次：大类资产配置策略、子资产单元划分策略、投资顾问选择策略和个券投资策略。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>1、战略性资产配置</p> <p>本产品为风险收益特征相对平衡的基金。为了保持平衡的风险收益特征，本基金的长期资产配置比例为权益类资产和固定收益类资产 6:4，并引入不同市场的权益资产增加组合的分散程度。本基金的战略资产配置方案为：A 股权益类资产的投资占比为 50%，港股权益类资产的投资占比为 10%，固定收益类资产的投资占比为 40%。</p> <p>2、战术性组合调整</p> <p>为进一步增强组合收益并控制最大回撤，本基金根据对市场的判断对战略资产配置方案进行调整，可以将权益类资产占比最低调整到 30%，最高调整至 75%。</p> <p>（二）子资产单元划分策略</p>

	<p>本基金分为价值、成长和固定收益三个子资产单元，三个子资产单元间相关性较低，能够有效分散风险。本基金对价值和成长单元进行均衡配置，能够充分利用两者超额收益负相关所带来的分散化效果，达到熨平波动，稳健增值的目的。</p> <p>（三）投资顾问选择策略</p> <p>本基金选择具备长期稳定业绩、良好风险控制能力以及综合实力强的公募基金管理人作为投资顾问。</p> <p>1、投资顾问的选聘</p> <p>（1）投资顾问应为公募基金管理人，具有丰富的投资管理经验，具有良好的合规和诚信记录，以及具有充分的风险识别和承受能力。</p> <p>（2）基金管理人遵循定量分析与定性尽职调查相结合的原则对符合标准的投资顾问及其拟聘任投资经理做进一步筛选。其中定量分析包括对投资顾问的产品、规模、业绩等方面的指标进行量化评价和初选。对投资顾问拟聘任的投资经理所管理产品的绩效指标（收益、夏普率、信息比率等）、风险控制指标（最大回撤、波动率等）、行业和风格偏好等指标进行量化评价和初选。</p> <p>2、投资顾问的监督、考核与评估</p> <p>根据与投资顾问签署的投顾协议的约定，基金管理人会对投资顾问及投资经理每年度进行业绩考核，对连续两次考核均不达产单元业绩比较基准的，建信基金需重新评估投资经理的适合性，根据需要要求投资顾问变更投资经理。</p> <p>3、投资顾问的解聘</p> <p>对于投资顾问聘用的投资经理，连续两次考核均不达产单元业绩比较基准的，基金管理人需重新评估投资经理的适合性，根据需要要求投资顾问变更投资经理，并对投资顾问拟聘用的新的投资经理进行尽职调查、综合评价，出具研究报告，由投资决策委员会进行评审。如投资顾问拒绝或未能在基金管理人要求的时间内更换投资经理，基金管理人需根据投顾协议的约定解聘其做为投资顾问。</p> <p>（四）个券投资策略</p>
业绩比较基准	50%×中证 800 指数收益率+10%×恒生指数收益率+40%×中债综合财富指数收益率
风险收益特征	<p>本基金为混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型管理人中管理人基金，高于债券型基金、债券型管理人中管理人基金及货币市场基金及货币型管理人中管理人基金。本基金的基金资产如投资于港股，会面临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。基金管理人将参考各投资顾问的建议进行投资操作，因此投资顾问的投资管理水平和各资产单元的业绩表现将影响基金的业绩表现。基金管理人虽然对投资顾问进行了严格的尽职调查，但不能保证投资顾问的投资建议一定准确有效。</p>
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
基金投资顾问	广发基金管理有限公司
	景顺长城基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-10,639,375.00
2. 本期利润	14,609,102.19
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0069
4. 期末基金资产净值	1,706,488,481.24
5. 期末基金份额净值	0.8281

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、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。

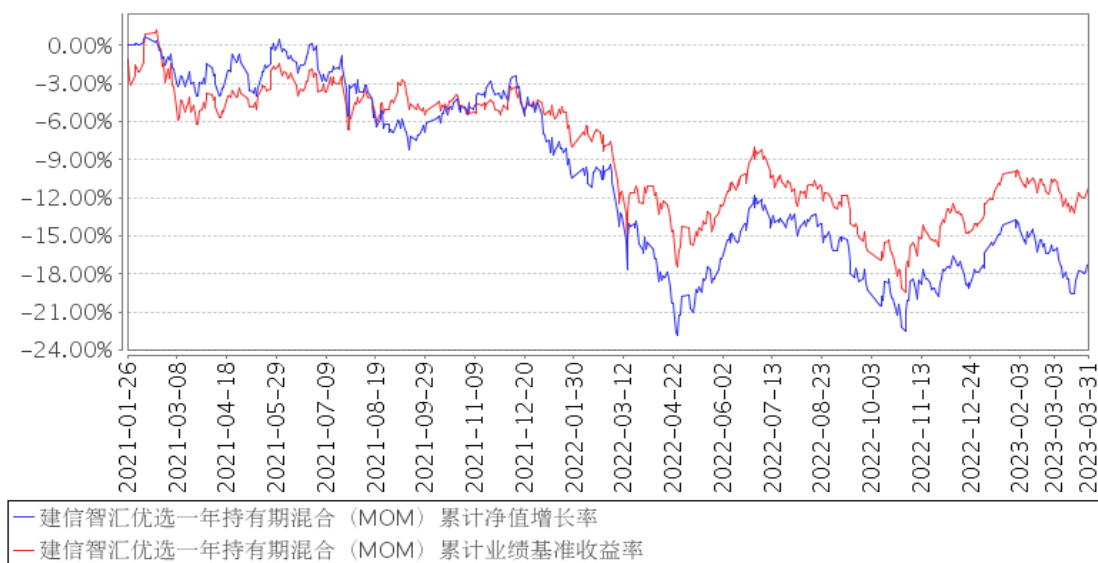
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率 ①	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	0.80%	0.59%	3.30%	0.50%	-2.50%	0.09%
过去六个月	2.54%	0.71%	5.83%	0.65%	-3.29%	0.06%
过去一年	-1.38%	0.74%	0.44%	0.69%	-1.82%	0.05%
自基金合同 生效起至今	-17.19%	0.72%	-11.25%	0.69%	-5.94%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

建信智汇优选一年持有期混合（MOM）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜华	数量投资部高级基金经理，本基金的基金经理	2021年1月26日	-	14	姜华先生，数量投资部高级基金经理，硕士。曾任中国农业银行大连中山支行担任信贷部经理、新华人寿保险股份有限公司精算部资产负债管理高级专员、安永（中国）企业咨询有限公司北京分公司高级精算咨询顾问、新华资产管理股份有限公司投资经理、量化投资负责人。2017年2月加入我公司，历任资产配置及量化投资部投资经理、FOF 基金经理、资产配置及量化投资部首席 FOF 投资官、高级基金经理等职务。2019年1月10日起担任建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）的基金经理；2019年8月6日至2023年2月15日任建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF）的基金经理；2021年1月26日起任建信智汇优选一年持有期混合型管

					理人中管理人（MOM）证券投资基金的基金经理；2023 年 2 月 15 日起任建信优享进取养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、建信普泽养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、建信龙祥稳进 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、建信优享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理；2023 年 3 月 29 日起任建信优享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。
梁珉	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2021 年 1 月 26 日	2023 年 2 月 15 日	17	梁珉先生，数量投资部副总经理，硕士。曾任鹏华基金管理有限公司金融工程部研究员。2007 年 7 月加入我公司，历任创新发展部产品开发专员、产品开发主管、部门副总监、部门执行总监、量化衍生品条线执行总经理、资产配置及量化投资部总经理等职务。2017 年 11 月 2 日至 2023 年 2 月 15 日任建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）的基金经理；2019 年 1 月 31 日至 2023 年 3 月 30 日任建信优享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理；2019 年 6 月 5 日至 2023 年 3 月 30 日任建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF）的基金经理；2021 年 1 月 26 日至 2023 年 2 月 15 日起任建信智汇优选一年持有期混合型基金管理人中管理人（MOM）证券投资基金的基金经理；2021 年 7 月 14 日至 2023 年 3 月 30 日任建信普泽养老目标 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理；2021 年 11 月 30 日至 2023 年 2 月 15 日任建信龙祥稳进 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理；2022 年 4 月 15 日至 2023 年 3 月 30 日任建信优享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理；2022 年 5 月 31 日至 2023 年 3 月 30 日任建信普泽养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理；2022 年 12 月 21 日至 2023 年 3 月 30 日任建信优享进取养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。

4.1.1 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

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与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的 5% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年 1 季度，权益市场整体呈倒 V 型走势，1 月整体上涨，2-3 月震荡回调；市场风格和热点快速切换，3 月以来主题行情极致演绎；固收市场在银行理财赎回潮逐渐消退后，债券利率重新回落，其中信用债收益率修复较明显。

权益方面，1 月随着疫情快速过峰和美元指数的快速回落，经济复苏预期回暖、北上资金大幅流入，主要股指全面上涨。春节后基于基本面实际情况，此前过于乐观的复苏预期有所修正，叠加美元指数止跌回升、北上资金流入告一段落，权益市场冲高回落，同时资金转换到中小成长板块，人工智能掀起了第一轮上涨。3 月初 PMI 数据大超预期，但随后两会政府工作报告将经济增速目标定在 5%、CPI 数据走弱超预期，市场对基本面的预期快速修正，大盘股经历了一轮 5% 左

右的回调；3月中下旬，海外银行风险事件发酵、美联储政策转向预期急剧升温，国内央行意外降准、流动性宽松，而 Chat GPT 带动 AI 产业在全球范围内加速推进，TMT 板块受到资金追捧，市场情绪升温，主题行情极致演绎。

固收方面，1 季度随着银行理财赎回潮消退，信用债配置力量较强，收益率整体修复。1-2 月受过节需求、信贷投放增加等因素影响，资金面总体偏紧，资金价格明显上行；3 月中，央行在超额续作 MLF 之后，降准 0.25 个百分点时点超预期，3 月末央行还加大了逆回购操作，流动性转松。1 季度，市场对经济增长及政策刺激力度的预期波动反复，在此背景下利率债呈窄幅震荡走势；而随着理财规模企稳，信用债配置需求增强，1 季度信用债收益率逐步修复，信用利差全面收窄。

权益方面，我们维持对 2023 年全年市场偏积极的看法。一方面，流动性环境会对市场形成托底；另一方面，经济内生动能仍较强，未来基本面还将持续修复。市场情绪方面，在人工智能方向投资情绪高亢的助推下，科技成长风格主线或将保持强劲，市场整体热度有望维持。未来主要风险点可能在于美联储加息和地缘政治风险超预期。总体上我们认为市场中长期上行趋势不改，短期或阶段性高低切换。

风格上，我们看好以下投资主线：一是人工智能驱动的产业浪潮深化带来的 TMT 板块投资机会，包括人工智能、大数据、云计算、算力、存储等。二是财报季开启阶段关注 1 季报业绩优秀且超跌的电力设备、医药生物、食品饮料等行业板块，可能会存在一定的修复性机会；三是美国经济衰退叠加联储宽松预期提升，中期布局黄金板块的机遇期已开启；此外，我们还关注有投资机会的部分细分板块如中药、航空等。

固收方面，全年来看预计货币政策以稳为主，基本面延续自然修复态势，我们对债市总体持中性偏谨慎观点。短期来看，政策方面近期重点关注 4 月政治局会议的政策定调，预计对债市形成冲击的风险有限；在弱复苏确认、政策刺激偏弱的背景下，近期部分高频数据出现走弱迹象，叠加资金面趋松，利率不排除短期小幅震荡向下。我们认为固收市场阶段性具备配置价值，但也要提防经济复苏持续性超预期带来的调整风险。

回顾报告期内的运作，管理人通过量化资产配置模型对组合整体的风格敞口与行业敞进行了监测管理，在组合基本贴合业绩基准的基础上持续优化结构。同时，动态平衡投资顾问的投资分配，优势互补、分散风险、降低波动。债券部分以持有短久期高等级信用债为主，获取票息收益，为组合提供稳健安全垫收益。

操作上，我们将继续秉持稳中求进的原则，充分发挥 MOM 产品多元化、分散化的特点与优势，与投资顾问深度合作，通过宏观掌控战略配置、中观调节战术策略、微观关注底层资产的精细化

管理模式，紧密跟踪市场变化，跟踪企业盈利，把握政策导向，发掘投资线索。

从投资顾问景顺长城来看，春节前，市场延续了 2022 年底的风格，受益于经济复苏的消费品、出行链表现较好，但春节后，低估值大盘股、央企蓝筹和 TMT 相关表现较为强劲，尤其是与人工智能主题相关的 TMT 板块，成为近期市场最强的主线。经济层面，国内呈现弱复苏迹象。外部环境上，美联储大幅加息后，以硅谷银行为代表的银行体系出现经营压力，引发投资人担忧。展望下一阶段，首先我们判断企业整体盈利在未来的几个季度大概率增速是持续上行的。其次从流动性角度看，伴随经济逐渐复苏，社融总量的增速有所上行，意味着实体经济对流动性的需求在增加，但我们也没有看到金融市场流动性有显著的收缩，预计后续市场流动性仍将保持大致平稳。第三，从估值角度看，市场整体估值大致处于历史平均水平，但是结构分化较大。在政策角度，我们坚持之前的判断：新一届政府对经济恢复的重视程度较高，各类产业政策偏温和，有利于权益市场。综合以上四点，我们觉得 A 股市场目前整体上仍以结构性行情为主。仍继续看好受益于经济复苏的可选消费、估值和基本面见底的医药、电子，以及具有成长空间的化工、机械设备等个股投资机会。

从投资顾问广发基金来看，宏观经济“弱复苏”已成定论，市场呈现出非常明显的结构性特征。一方面，在海外 ChatGPT 的引领下，国内企业纷纷开始对大模型进行研发，AI 相关的行业出现了大幅上涨。另一方面，新能源、军工等行业虽然基本面较好，但是持续走低，市场“跷跷板”效应非常明显。展望二季度，美国经济衰退担忧加大，外围风险仍有扰动。由于美国、欧洲的库存水平处于历史高位，所以从海运价格，以及出口数据看，全球陷入衰退的可能性正在加大，国内货币政策有望维持宽松。由于稳增长、稳消费等政策预期的落空，国内宏观经济“弱复苏”的态势在二季度仍将延续。当前市场结构性特征非常明显，由于宏观经济缺乏亮点，资金比较充沛，市场的风险偏好大幅提升，TMT 板块内部的轮动暂时没看到结束的迹象，并有望在二季度继续演绎人工智能各个方向的逻辑扩散行情。4 月即将进入到需要验证业绩的窗口期，弱预期、强现实的新能源板块有望止跌反弹。长期来看关注消费品、医药、家电、银行等行业中长期保持较高 ROE 且稳定增长的龙头。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 0.80%，波动率 0.59%，业绩比较基准收益率 3.30%，波动率 0.50%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,114,958,921.54	65.04
	其中：股票	1,114,958,921.54	65.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	356,292,241.10	20.78
	其中：债券	356,292,241.10	20.78
	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	242,969,361.91	14.17
8	其他资产	150,680.45	0.01
9	合计	1,714,371,205.00	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 106,208,502.58 元，占期末基金资产净值比例为 6.22%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	8,066,633.37	0.47
B	采矿业	11,930,331.00	0.70
C	制造业	848,947,324.39	49.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,702,500.00	0.16
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,548,932.00	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	9,005,968.00	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,301,708.00	2.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	16,465,017.00	0.96
M	科学研究和技术服务业	28,359,240.00	1.66
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	8,818,105.20	0.52
R	文化、体育和娱乐业	2,775,630.00	0.16
S	综合	22,829,030.00	1.34
	合计	1,008,750,418.96	59.11

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值 (人民币)	占基金资产净值比例 (%)
Materials 材料	-	-
Consumer Staples 日常生活消费品	-	-
Consumer Discretionary 非日常消费品	20,042,495.32	1.17
Energy 能源	20,521,816.43	1.20
Financials 金融	-	-
Health Care 医疗保健	20,549,258.53	1.20
Industrials 工业	-	-
Real Estate 房地产	15,877,446.51	0.93
Information Technology 信息技术	3,565.90	0.00
Telecommunication Services 通讯服务	29,213,919.89	1.71
Utilities 公用事业	-	-
合计	106,208,502.58	6.22

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	237,000	46,689,000.00	2.74
2	600519	贵州茅台	22,500	40,950,000.00	2.40
3	000568	泸州老窖	147,500	37,581,525.00	2.20
4	002463	沪电股份	1,495,700	32,142,593.00	1.88
5	00700	腾讯控股	86,500	29,213,919.89	1.71
6	603259	药明康德	356,720	28,359,240.00	1.66
7	300750	宁德时代	67,500	27,408,375.00	1.61
8	300408	三环集团	777,050	23,389,205.00	1.37
9	688599	天合光能	444,767	23,167,913.03	1.36
10	000589	贵州轮胎	4,476,980	22,877,367.80	1.34

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	141,460,602.19	8.29
	其中：政策性金融债	61,004,821.91	3.57
4	企业债券	92,036,230.69	5.39
5	企业短期融资券	35,388,671.23	2.07
6	中期票据	87,406,736.99	5.12
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	356,292,241.10	20.88

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	190305	19 进出 05	500,000	50,545,164.38	2.96
2	115001	23 国联 S2	500,000	50,083,643.84	2.93
3	101900730	19 汇金 MTN010	300,000	31,336,763.84	1.84
4	175991	国电投 02	300,000	30,764,477.26	1.80
5	175731	21 银河 G4	300,000	30,372,136.44	1.78

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	128,105.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,574.91
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	150,680.45

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 管理人中管理人（MOM）产品

6.1 报告期末各资产单元的资产净值及占基金资产净值的比例

资产单元	投资顾问名称	报告期末资产单元资产净值（元）	占期末基金资产净值比例（%）
1	景顺长城基金管理有 限公司	631,964,916.00	37.03
2	广发基金管理有限公 司	560,412,288.49	32.84

6.2 基金投资顾问

序号	投资顾问名称	是否与基金管理 人存在关联关系	是否与其他投资顾问存在关联关 系
1	广发基金管理有限公 司	否	否
2	景顺长城基金管理有 限公司	否	否

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,135,617,762.52
报告期期间基金总申购份额	1,860,568.96
减：报告期期间基金总赎回份额	76,704,929.75
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,060,773,401.73

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

无。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金设立的文件；

2、《建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金基金合同》；

3、《建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金招募说明书》；

4、《建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金托管协议》；

5、基金管理人业务资格批件和营业执照；

6、基金托管人业务资格批件和营业执照；

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2023 年 4 月 21 日