
中信建投致远混合型证券投资基金

2024年第2季度报告

2024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:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2024年07月19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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年7月18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2024年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中信建投致远混合
基金主代码	019322
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年01月30日
报告期末基金份额总额	42,226,928.98份
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险和保持资产流动性的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用“自上而下”的大类资产配置策略和“自下而上”的股票投资策略相结合的方法进行投资，在考虑大类资产配置的基础上，通过定性和定量相结合的方式行业以及个股投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+中证综合债指数收益率×25%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×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。

基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属各类别基金的基金简称	中信建投致远混合A	中信建投致远混合C
下属各类别基金的交易代码	019322	019323
报告期末下属各类别基金的份额总额	32,220,231.34份	10,006,697.64份

§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(2024年04月01日 - 2024年06月30日)	
	中信建投致远混合A	中信建投致远混合C
1.本期已实现收益	639,659.06	430,129.56
2.本期利润	-984,281.49	-172,173.32
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0343	-0.0136
4.期末基金资产净值	31,815,908.30	9,864,536.10
5.期末基金份额净值	0.9875	0.9858

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

中信建投致远混合A净值表现

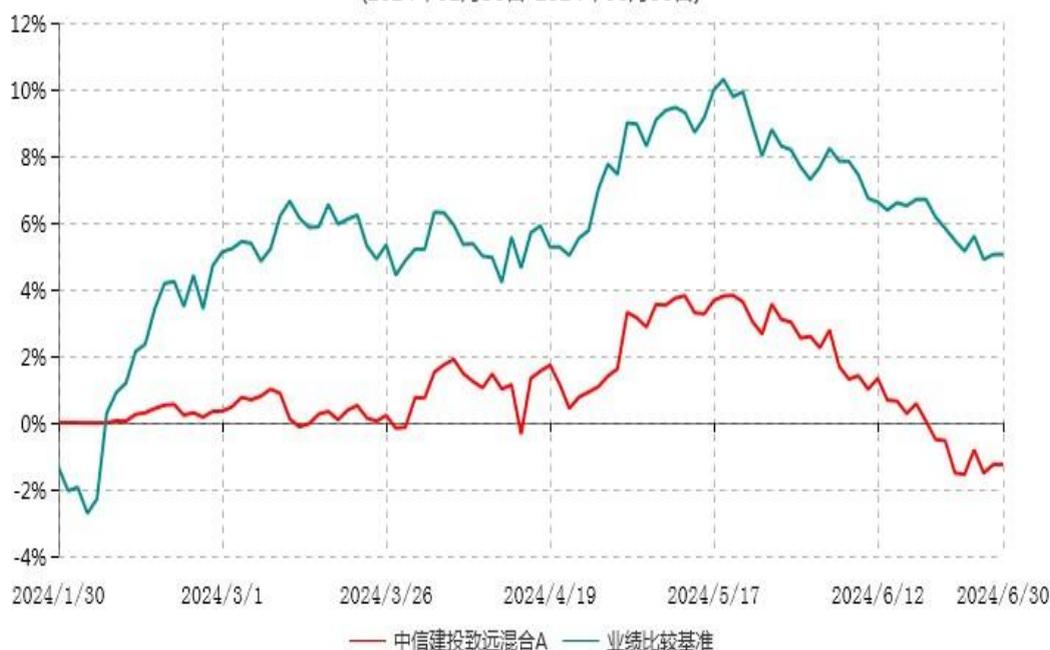
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.99%	0.55%	-0.15%	0.55%	-1.84%	0.00%
自基金合同生效起至今	-1.25%	0.46%	5.05%	0.63%	-6.30%	-0.17%

中信建投致远混合C净值表现

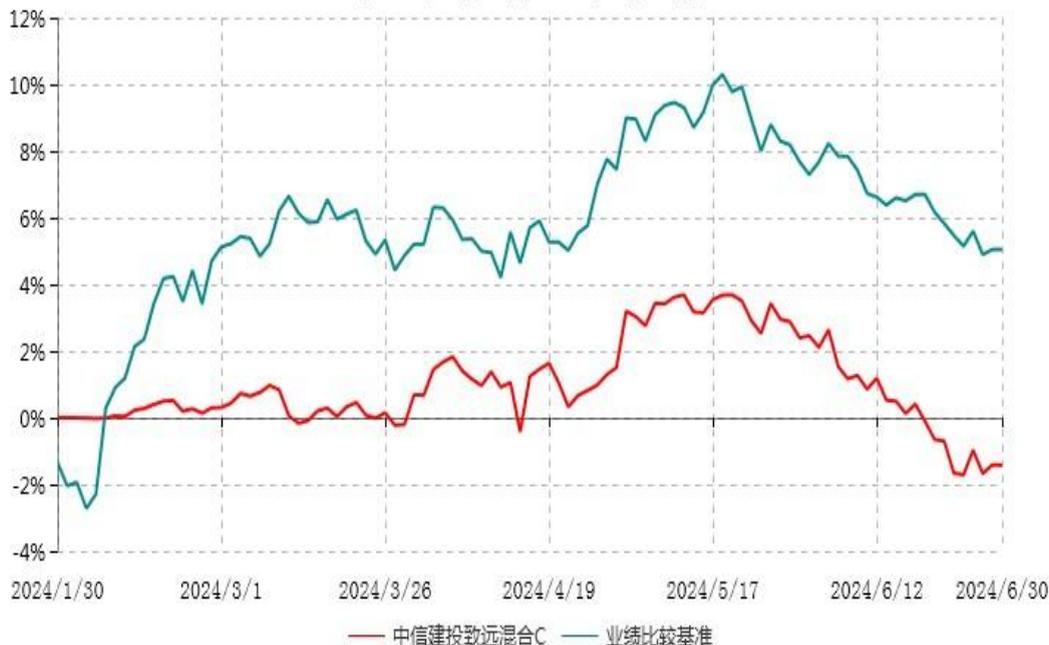
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.09%	0.55%	-0.15%	0.55%	-1.94%	0.00%
自基金合同生效起至今	-1.42%	0.46%	5.05%	0.63%	-6.47%	-0.17%

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

中信建投致远混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年01月30日-2024年06月30日)



中信建投致远混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年01月30日-2024年06月30日)



注：1、本基金基金合同生效于2024年1月30日，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。
2、根据本基金基金合同的约定，本基金自基金合同生效之日起6个月为建仓期，截至报告期末本基金尚处于建仓期内。

§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		
杨志武	本基金的基金经理、多元资产配置部行政负责人	2024-01-30	-	12年	中国籍，1986年10月生，伯明翰大学货币银行与金融学硕士。曾任职于北京首创期货有限责任公司期权及场外衍生品部从事衍生品投资与研究，中国国际期货股份有限公司金融业务部从事衍生品投资与研究，中邮创业基金管理股份有限公司创新业务部从事证券投资研究、权益投资部担任投资经理。2022年3月加入

					<p>中信建投基金管理有限公司，现任本公司多元资产配置部行政负责人、基金经理，担任中信建投稳利混合型证券投资基金、中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金、中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金、中信建投双鑫债券型证券投资基金、中信建投致远混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理任职日期、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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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》、基金合同和其他有关法律法规，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。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。

4.3 公平交易专项说明

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不公平交易的情况。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度A股冲高回落，伴随3月两会以及4月国务院颁布“国九条”政策推动，市场风险偏好快速修复，但是伴随步入5月中下旬经济数据陆续出台，尤其是前5个月房地产市场数据不及预期，抑制了市场的进一步向上修复，自5月底进入又一轮回调，市场成交活跃度下降，6月底A股市场的日成交金额仅在6000亿元的水平徘徊。从风格来看，红利显著跑赢成长：创业板指数二季度下跌6.83%、科创板指数下跌6.71%，而中证红利小幅度上涨0.55%。从市值来看，大小盘风格在二季度分化明显，核心蓝筹指数如沪深300下跌2.14%，但是中证1000下跌10.02%、万得微盘指数跌超25%。从行业来看，涨幅靠前的行业大多属于红利板块，其中银行（+17%）涨幅第一，成长（计算机-24.9%、传媒-21.3%）、大消费（商贸零售-24.6%、社会服务-24.1%）领跌。二季度我们秉持着追求长期稳健回报的原则，在一季度错失市场快速反弹后，没有急于博弈短期反弹，逐步增加仓位，努力在风格分化、市场波动加剧的环境下控制住产品的整体波动。

当下房地产政策不断放松，支持力度开始加大，但市场风险偏好的持续修复依然需要可观测的经济数据持续验证，如工业企业利润增长、PMI，同时也需要关注政府可能出台的支持政策包括房地产政策进一步放松，如扩大保障性住房再贷款规模、降低再贷款利率、进一步下调LPR、加大财政或准财政扩张力度以保障基建投资以及增强信贷支持力度。另外，美元步入加息的尾声，全球外汇市场开始频繁交易美元降息，但是需要考虑到大选年，以及地缘政治冲突，我们面临的贸易环境相对复杂，人民币兑美元的汇率双向波动风险都很大，一定程度压抑资金的风险偏好。考虑到A股当前处于历史估值的低位，在当前相对复杂的宏观环境下，我们会重点关注国内以红利、大盘蓝筹为代表的核心资产的长期配置机会；另一方面依然关注科技创新板块的投资机会：华为产业链、国防军工、消费电子、半导体等。

本基金追求长期的稳健回报，在风格和策略上，红利类策略依然是产品的底仓配置策略，同时关注GARP类策略阶段性的配置价值，即重点关注估值合理的高盈利增速公司的配置价值。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投致远混合A基金份额净值为0.9875元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.99%，同期业绩比较基准收益率为-0.15%；截至报告期末中信建投致远混合C基金份额净值为0.9858元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.09%，同期业绩比较基准收益率为-0.15%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期未发生连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人的情形。

本基金本报告期发生超过连续20个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。

§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	28,091,227.61	67.09
	其中：股票	28,091,227.61	67.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,192,020.61	12.40
	其中：债券	5,192,020.61	12.40
	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	4,500,000.00	10.75
	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	4,087,659.52	9.76
8	其他资产	-	-
9	合计	41,870,907.74	100.00

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	79,240.00	0.19
B	采矿业	1,229,809.80	2.95
C	制造业	14,929,877.31	35.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,893,877.00	4.54
E	建筑业	579,466.00	1.39
F	批发和零售业	422,526.00	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,042,585.00	4.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	404,834.26	0.97
J	金融业	5,065,730.00	12.15

K	房地产业	502,049.00	1.20
L	租赁和商务服务业	463,107.00	1.11
M	科学研究和技术服务业	141,444.00	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	51,232.24	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	121,734.00	0.29
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	163,716.00	0.39
S	综合	-	-
	合计	28,091,227.61	67.40

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

5.3 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	600887	伊利股份	19,000	490,960.00	1.18
2	601229	上海银行	63,800	463,188.00	1.11
3	601169	北京银行	75,900	443,256.00	1.06
4	000651	格力电器	11,300	443,186.00	1.06
5	600036	招商银行	10,700	365,833.00	0.88
6	601398	工商银行	63,000	359,100.00	0.86
7	603195	公牛集团	4,545	350,510.40	0.84
8	601658	邮储银行	69,100	350,337.00	0.84
9	600064	南京高科	56,300	341,741.00	0.82
10	600820	隧道股份	51,000	333,030.00	0.80

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	5,192,020.61	12.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,192,020.61	12.46

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	113052	兴业转债	7,420	802,952.86	1.93
2	118031	天23转债	7,000	649,965.63	1.56
3	128048	张行转债	5,350	585,913.82	1.41
4	113042	上银转债	2,540	288,733.25	0.69
5	113524	奇精转债	2,290	260,131.01	0.62

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
无余额。

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
无余额。

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
无余额。

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

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市 值(元)	公允价值变 动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-

股指期货投资本期收益（元）	-67,504.12
股指期货投资本期公允价值变动（元）	-

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，综合考虑股指期货不同合约之间的价差关系、流动性等因素，在各股指期货合约之间进行动态配置和临近到期合约的展期操作，以提升组合收益和套期保值的效果。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海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上海监管局、国家外汇管理局上海市分局的处罚，北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北京监管局的处罚，招商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、国家金融监督管理总局深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

无余额。

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	113052	兴业转债	802,952.86	1.93
2	118031	天23转债	649,965.63	1.56
3	128048	张行转债	585,913.82	1.41
4	113042	上银转债	288,733.25	0.69
5	113524	奇精转债	260,131.01	0.62
6	113037	紫银转债	248,166.54	0.60
7	127016	鲁泰转债	231,045.20	0.55

8	128129	青农转债	226,694.50	0.54
9	113545	金能转债	221,350.29	0.53
10	127042	嘉美转债	212,277.15	0.51
11	113056	重银转债	194,147.30	0.47
12	113054	绿动转债	190,144.26	0.46
13	128134	鸿路转债	189,555.02	0.45
14	127017	万青转债	185,990.68	0.45
15	113530	大丰转债	184,324.97	0.44
16	128144	利民转债	178,019.65	0.43
17	127052	西子转债	101,711.02	0.24
18	128130	景兴转债	95,973.55	0.23
19	113021	中信转债	72,072.29	0.17
20	110062	烽火转债	50,527.34	0.12
21	113526	联泰转债	22,324.28	0.05

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投致远混合A	中信建投致远混合C
报告期期初基金份额总额	38,624,701.18	23,527,285.35
报告期期间基金总申购份额	21,653,868.94	12,647,462.90
减：报告期期间基金总赎回份额	28,058,338.78	26,168,050.61
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	32,220,231.34	10,006,697.64

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240521-20240630	-	19,266,859.34	-	19,266,859.34	45.6269%
	2	20240417-20240418	7,999,411.11	-	5,600,000.00	2,399,411.11	5.6822%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2024年6月14日、6月17日、6月18日分别披露《中信建投基金管理有限公司关于以通讯方式召开中信建投致远混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》《中信建投基金管理有限公司关于以通讯方式召开中信建投致远混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》《中信建投基金管理有限公司关于以通讯方式召开中信建投稳致远混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》。

基金管理人于2024年7月16日披露《关于中信建投致远混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》《中信建投致远混合型证券投资基金基金合同》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投致远混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《中信建投致远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。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可以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

2024年07月19日