

中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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:中国银行股份有限公司

送出日期:2023 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，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月30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2023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 | 6 |
| 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 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 8 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 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 | 12 |
| 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 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 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等内容真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| §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 | 16 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 19 |
| §7 投资组合报告 | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 43 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 44 |
| 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 | 45 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 46 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 47 |
| 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 | 48 |
| §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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 49 |

| | |
|--|----|
| 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情况 | 49 |
| §9 开放式基金份额变动 | 50 |
| §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 | 51 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 51 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 51 |
| 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 | 51 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 51 |
| 10.8 其他重大事件 | 52 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 53 |
| 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 | 53 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 53 |
| §12 备查文件目录 | 53 |
| 12.1 备查文件目录 | 53 |
| 12.2 存放地点 | 54 |
| 12.3 查阅方式 | 54 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|------------------|--------------------------|------------------|
| 基金名称 | 中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 中信建投北交所精选两年定开混合 | |
| 基金主代码 | 016303 | |
| 基金运作方式 | 契约型、定期开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2022年08月16日 | |
| 基金管理人 | 中信建投基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 267,006,443.63份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属各类别基金的基金简称 | 中信建投北交所精选两年定开混合A | 中信建投北交所精选两年定开混合C |
| 下属各类别基金的交易代码 | 016303 | 016304 |
| 报告期末下属各类别基金的份额总额 | 220,509,584.69份 | 46,496,858.94份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金主要投资于在北京证券交易所上市的企业，在严格控制投资组合风险和保持资产流动性的前提下，灵活运用多种投资策略，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”的资产配置策略，在综合判断宏观经济基本面、流动性水平等宏观因素的基础上，通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在个券投资方面采用“自下而上”精选策略，通过严谨个股选择、信用分析以及对券种收益水平、流动性的客观判断，综合运用多种投资策略，精选个券构建投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 中证1000指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债综合指数收益率×20% |

| | |
|---------------|--|
| <p>风险收益特征</p> | <p>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。</p> <p>本基金主要投资于北京证券交易所上市的证券，除了需要承担与证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临投资北京证券交易所上市证券的特殊风险。</p> <p>本基金可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。</p> |
|---------------|--|

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 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 朱伟 | 许俊 |
| | 联系电话 | 010-59100208 | 010-66596688 |
| | 电子邮箱 | zhuweibj@csc.com.cn | fxjd_hq@bank-of-china.com |
| 客户服务电话 | | 4009-108-108 | 95566 |
| 传真 | | 010-59100298 | 010-66594942 |
| 注册地址 | | 北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室 | 北京市西城区复兴门内大街1号 |
| 办公地址 | | 北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17、19层 | 北京市西城区复兴门内大街1号 |
| 邮政编码 | | 100010 | 100818 |
| 法定代表人 | | 黄凌 | 葛海蛟 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.cfund108.com |
| 基金中期报告备置地点 | 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2号凯恒 |

| | | |
|--|--|------------|
| | | 中心B座17、19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 (2023年01月01日-2023年06月30日) | |
|---------------|----------------------------------|------------------|
| | 中信建投北交所精选两年定开混合A | 中信建投北交所精选两年定开混合C |
| 本期已实现收益 | 3,167,508.23 | 572,612.19 |
| 本期利润 | -870,279.82 | -274,227.06 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0039 | -0.0059 |
| 本期加权平均净值利润率 | -0.39% | -0.58% |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.40% | -0.60% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 (2023年06月30日) | |
| 期末可供分配利润 | -2,420,610.56 | -670,401.47 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0110 | -0.0144 |
| 期末基金资产净值 | 218,088,974.13 | 45,826,457.47 |
| 期末基金份额净值 | 0.9890 | 0.9856 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 (2023年06月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | -1.10% | -1.44% |

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、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果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（已实现部分相抵未实现部分）。

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

中信建投北交所精选两年定开混合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 | -2.44% | 0.58% | 1.07% | 0.81% | -3.51% | -0.23% |
| 过去三个月 | -2.24% | 0.74% | -2.79% | 0.71% | 0.55% | 0.03% |
| 过去六个月 | -0.40% | 0.86% | 3.82% | 0.69% | -4.22% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.10% | 0.64% | -6.04% | 0.84% | 4.94% | -0.20% |

中信建投北交所精选两年定开混合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 | -2.46% | 0.58% | 1.07% | 0.81% | -3.53% | -0.23% |
| 过去三个月 | -2.33% | 0.74% | -2.79% | 0.71% | 0.46% | 0.03% |
| 过去六个月 | -0.60% | 0.86% | 3.82% | 0.69% | -4.42% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.44% | 0.64% | -6.04% | 0.84% | 4.60% | -0.20% |

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

中信建投北交所精选两年定开混合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
(2022年08月16日-2023年06月30日)



中信建投北交所精选两年定开混合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
(2022年08月16日-2023年06月30日)



注：1、本基金基金合同生效于2022年8月16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，建仓期结束后本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§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基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，中信建投基金共管理50只公募证券投资基金。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。

中信建投基金作为资产管理公司，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 | | |
| 周紫光 | 本基金的 基金经理、 研究部行 政负责人 | 2022-08-16 | - | 13年 | 中国籍，1983年7月生，大连理工大学工学硕士。曾任江海证券有限责任公司研究员、平安证券股份有限公司研究员、方正证券股份有限公司研究员。2016年3月加入中信建投基金管理有限公司，曾任投资研究部研究员，现任本公司研究部行政负责人、基金经理，担任中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金、中信建投智享生活混合型证券投资基金、中 |

| | | | | | |
|----|----------|------------|---|----|---|
| | | | | | 信建投低碳成长混合型证券投资基金、中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金、中信建投科技主题6个月持有期混合型证券投资基金基金经理。 |
| 孙文 | 本基金的基金经理 | 2022-08-16 | - | 6年 | 中国籍，1990年10月生，对外经济贸易大学金融学硕士。2016年7月加入中信建投基金管理有限公司，曾任交易部股票交易员、研究部研究员、权益投资部基金经理助理，现任本公司权益投资一部基金经理，担任中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。 |

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销售机构监督管理办法》《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》《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，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《证券投资基金管理人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 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

2023年上半年，在国内经济较差以及对整体宏观预期很悲观的背景下，资本市场从通缩演绎到了衰退，因此出现了典型的经济差、炒主题的行情。由于我们对宏观经济的预期没有市场整体那么悲观，以及对后续的发展趋势也并不悲观，所以判断错了市场风格和方向，导致上半年基金净值表现较差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投北交所精选两年定开混合A基金份额净值为0.9890元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.40%，同期业绩比较基准收益率为3.82%；截至报告期末中信建投北交所精选两年定开混合C基金份额净值为0.9856元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.60%，同期业绩比较基准收益率为3.82%。

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，我们认为经济有望见底，市场预期有转暖的可能性。虽然主题方向或许仍有机会，但基本面风格可能回归，前期大跌的部分板块，有些估值已到非常低的位置，本身具备修复的空间，如果基本面确实转好，则向上弹性可能较大。

上半年，我们基于深入研究，增加了些优质公司的配置比例。后续，我们将会继续深耕北交所，侧重绝对收益思路，优选股票构建组合，希望获得较好的结果。

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、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，符合相关法规及基金合同的规定。

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人或者基金资产净值低于5000万元的情形。

§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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 70,932,781.60 | 233,859,093.61 |
| 结算备付金 | | 97,008.66 | - |
| 存出保证金 | | 117,651.17 | 2,440.87 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 193,262,342.72 | 46,965,532.50 |
| 其中：股票投资 | | 193,262,342.72 | 46,965,532.50 |
| 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 | - | - |
| 债权投资 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 264,409,784.15 | 280,827,066.98 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022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 | | - | 15,242,469.17 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 328,359.87 | 338,264.59 |
| 应付托管费 | | 54,726.65 | 56,377.45 |
| 应付销售服务费 | | 15,206.58 | 15,691.03 |
| 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 | 96,059.45 | 114,326.26 |
| 负债合计 | | 494,352.55 | 15,767,128.50 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 267,006,443.63 | 267,006,443.63 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | -3,091,012.03 | -1,946,505.15 |
| 净资产合计 | | 263,915,431.60 | 265,059,938.48 |
| 负债和净资产总计 | | 264,409,784.15 | 280,827,066.98 |

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额总额267,006,443.63份，其中A类基金份额净值0.9890元，基金份额220,509,584.69份；C类基金份额净值0.9856元，基金份额46,496,858.94份。

6.2 利润表

会计主体：中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023年01月01日至2023年 06月30日 |
|-----------------------|----------|-----------------------------------|
| 一、营业总收入 | | 1,383,477.99 |
| 1.利息收入 | | 165,200.50 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 165,200.50 |
| 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 | | - |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 6,102,904.79 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | 4,159,088.71 |
| 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 | 1,943,816.08 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - |
| 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 | -4,884,627.30 |

| | | |
|----------------------------|------------|----------------------|
| 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 | - |
| 减：二、营业总支出 | | 2,527,984.87 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 2,014,356.01 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 335,726.01 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 93,350.29 |
| 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 | 84,552.56 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -1,144,506.88 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -1,144,506.88 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | -1,144,506.88 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | | | |
|-----------------|-------------------------------|--------|---------------|----------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 267,006,443.63 | - | -1,946,505.15 | 265,059,938.48 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|----------------|---|---------------|----------------|
| 错更正 | | | | |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 267,006,443.63 | - | -1,946,505.15 | 265,059,938.48 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | - | - | -1,144,506.88 | -1,144,506.88 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -1,144,506.88 | -1,144,506.88 |
| （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） | - | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - | - |
| （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）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 267,006,443.63 | - | -3,091,012.03 | 263,915,431.60 |

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:

黄凌

谭淼

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

中信建投北交所精选两年定期开放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〕1503号《关于准予中信建投北交所精选两年定期开放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《中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金的运作方式为契约型、定期开放式，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266,986,129.03元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验资（2022）第0714号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2022年8月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为267,006,443.63份基金份额，其中认购资金利息折合20,314.60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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中信建投北交所精选两年定期开放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、申购费用而不收取销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类基金份额和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《中信建投北交所精选两年定期开放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（含主板、创业板、北京证券交易所发行上市股票及其他中国证监会允许基金投资的股票、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、证券公司短期公司债券、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)。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。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。基金的投资组合比例为:封闭期内本基金股票资产占基金资产的比例为60%-100%,开放期内本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%,其中港股通股票不超过股票资产的20%;本基金投资于北京证券交易所上市股票的比例不低于非现金基金资产的80%;每个封闭期结束前的1个月至开放期结束后1个月内不受上述比例限制。在开放期内每个交易日日终,扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;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1000指数收益率×70%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×10%+中债综合指数收益率×20%。

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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<年度报告和中期报告>》、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》、《中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》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

本基金2023年1月1日至2023年6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2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6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

本基金会计年度为公历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2023年1月1日至2023年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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；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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

6.4.4.5 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)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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)当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。对于已开放转换业务的基金，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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 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基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。

本基金收益分配方式分两种：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。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 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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告〔2017〕13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、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流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发〔2017〕6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称"指引")，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告〔2017〕13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、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》、财税〔2016〕36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、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》、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》、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》、财税〔2017〕2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4) 基金卖出股票按0.1%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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 | |
|--------------|---------------|--|
| | 2023年06月30日 | |
| 活期存款 | 70,932,781.60 | |
| 等于：本金 | 70,925,685.81 | |
| 加：应计利息 | 7,095.79 | |
| 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 | - | |
| 等于：本金 | - | |
| 加：应计利息 | - | |
| 减：坏账准备 | - | |
| 合计 | 70,932,781.60 | |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | | | |
|----------|----------------|------|----------------|---------------|
| | 2023年06月30日 | | | |
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 198,500,750.90 | - | 193,262,342.72 | -5,238,408.18 |
| 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 | 198,500,750.90 | - | 193,262,342.72 | -5,238,408.18 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 2023年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 11,756.89 |
| 其中：交易所市场 | 11,756.89 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |

| | |
|------|-----------|
| 预提费用 | 84,302.56 |
| 合计 | 96,059.45 |

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中信建投北交所精选两年定开混合A

金额单位：人民币元

| 项目 (中信建投北交所精选两年定 开混合A) | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | |
|------------------------------|-------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 220,509,584.69 | 220,509,584.69 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 220,509,584.69 | 220,509,584.69 |

6.4.7.7.2 中信建投北交所精选两年定开混合C

金额单位：人民币元

| 项目 (中信建投北交所精选两年定 开混合C) | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | |
|------------------------------|-------------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 46,496,858.94 | 46,496,858.94 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 46,496,858.94 | 46,496,858.94 |

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中信建投北交所精选两年定开混合A

单位：人民币元

| 项目 (中信建投北交所精选 两年定开混合A) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|------------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期期初 | -1,258,105.52 | -292,225.22 | -1,550,330.74 |
| 本期利润 | 3,167,508.23 | -4,037,788.05 | -870,279.82 |

| | | | |
|----------------|--------------|---------------|---------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,909,402.71 | -4,330,013.27 | -2,420,610.56 |

6.4.7.8.2 中信建投北交所精选两年定开混合C

单位：人民币元

| 项目 (中信建投北交所精选两年定开混合C) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|--------------------------|-------------|-------------|-------------|
| 本期期初 | -334,618.75 | -61,555.66 | -396,174.41 |
| 本期利润 | 572,612.19 | -846,839.25 | -274,227.06 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 237,993.44 | -908,394.91 | -670,401.47 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 162,012.65 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 2,322.76 |
| 其他 | 865.09 |
| 合计 | 165,200.50 |

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|-------------------------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 12,367,410.22 |
| 减：卖出股票成本总额 | 8,056,953.71 |
| 减：交易费用 | 151,367.80 |
| 买卖股票差价收入 | 4,159,088.71 |

6.4.7.11 债券投资收益

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 |
|---------------|-------------------------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 1,943,816.08 |
| 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 | 1,943,816.08 |

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------|-------------------------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 1.交易性金融资产 | -4,884,627.30 |
| ——股票投资 | -4,884,627.30 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |

| | |
|------------------------|---------------|
| ——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 | -4,884,627.30 |

6.4.7.15 其他收入

无。

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 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 审计费用 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 汇划手续费 | 250.00 |
| 合计 | 84,552.56 |

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 |
|-----------------|---------------------|
| 中国银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 中信建投基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、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 |
| 元达信资本管理（北京）有限公司 | 基金管理人的子公司 |

注：元达信资本管理（北京）有限公司于2023年7月更名为中信建投利信资本管理（北京）有限公司。

以下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

无。

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

无。

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 |
|-----------------|-------------------------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,014,356.01 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 994,747.48 |

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1.50%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×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|-------------------------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 335,726.01 |

注：支付基金托管人中国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，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×0.25%/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 | | |
|----------------|-------------------------|------------------|----------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 中信建投北交所精选两年定开混合A | 中信建投北交所精选两年定开混合C | 合计 |
| 中国银行股份有限公司 | 0.00 | 1,942.24 | 1,942.24 |
| 中信建投基金管理有限公司 | 0.00 | 3.62 | 3.62 |

| | | | |
|----------------------|------|-----------|-----------|
| 中信建投 证券股份 有限公司 | 0.00 | 77,891.00 | 77,891.00 |
| 合计 | 0.00 | 79,836.86 | 79,836.86 |

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

无。

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 2023年01月01日至2023年06月30日 | |
|------------|-------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行股份有限公司 | 70,932,781.60 | 162,012.65 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国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

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2023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，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，违约风险可能性很小；在银行间同业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。

于2023年6月30日，本基金无债券投资（2022年12月31日：同）。

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可于约定开放日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2023年6月30日，除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额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同约定到期日均为一个月以内且不计息，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》且于基金开放期内按照《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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。

于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2023年6月30日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023 年 06 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 | 70,932,781.60 | - | - | - | 70,932,781.60 |
| 结算备付金 | 97,008.66 | - | - | - | 97,008.66 |
| 存出保证金 | 117,651.17 | - | - | - | 117,651.17 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 193,262,342.72 | 193,262,342.72 |
| 资产总计 | 71,147,441.43 | - | - | 193,262,342.72 | 264,409,784.15 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 328,359.87 | 328,359.87 |
| 应付托管费 | - | - | - | 54,726.65 | 54,726.65 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 15,206.58 | 15,206.58 |
| 其他负债 | - | - | - | 96,059.45 | 96,059.45 |
| 负债总计 | - | - | - | 494,352.55 | 494,352.55 |
| 利率敏感度缺口 | 71,147,441.43 | - | - | 192,767,990.17 | 263,915,431.60 |

| 上年度末 2022 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 | 233,859,093.61 | - | - | - | 233,859,093.61 |
| 存出保证金 | 2,440.87 | - | - | - | 2,440.87 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 46,965,532.50 | 46,965,532.50 |
| 资产总计 | 233,861,534.48 | - | - | 46,965,532.50 | 280,827,066.98 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 15,242,469.17 | 15,242,469.17 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 338,264.59 | 338,264.59 |
| 应付托管费 | - | - | - | 56,377.45 | 56,377.45 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 15,691.03 | 15,691.03 |
| 其他负债 | - | - | - | 114,326.26 | 114,326.26 |
| 负债总计 | - | - | - | 15,767,128.50 | 15,767,128.50 |
| 利率敏感度缺口 | 233,861,534.48 | - | - | 31,198,404.00 | 265,059,938.48 |

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2023年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2022年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022年12月31日：同）。

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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 2023年06月30日 | | 上年度末 2022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 | 193,262,342.72 | 73.23 | 46,965,532.50 | 17.72 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - |

| | | | | |
|-------------|----------------|-------|---------------|-------|
| 产—贵金属投资 | | | | |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 193,262,342.72 | 73.23 | 46,965,532.50 | 17.72 |

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 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| | 业绩比较基准上升5% | 4,536,694.91 | 21,528.03 |
| | 业绩比较基准下降5% | -4,536,694.91 | -21,528.03 |

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

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次 | 193,262,342.72 | 46,965,532.50 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 193,262,342.72 | 46,965,532.50 |

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§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 | 193,262,342.72 | 73.09 |
| | 其中：股票 | 193,262,342.72 | 73.09 |
| 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 | 71,029,790.26 | 26.86 |
| 8 | 其他各项资产 | 117,651.17 | 0.04 |
| 9 | 合计 | 264,409,784.15 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 173,503,913.06 | 65.74 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,649,800.00 | 1.38 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 14,603,829.66 | 5.53 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,504,800.00 | 0.57 |
| 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 193,262,342.72 | 73.23 |

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(元) | 占基金资产 净值比例 (%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|----------------------|
| 1 | 831152 | 昆工科技 | 960,088 | 24,472,643.12 | 9.27 |
| 2 | 834033 | 康普化学 | 750,020 | 24,450,652.00 | 9.26 |
| 3 | 838402 | 硅烷科技 | 1,619,632 | 19,937,669.92 | 7.55 |
| 4 | 836077 | 吉林碳谷 | 782,000 | 15,976,260.00 | 6.05 |
| 5 | 430425 | 乐创技术 | 700,523 | 11,012,221.56 | 4.17 |
| 6 | 839371 | 欧福蛋业 | 2,943,300 | 10,272,117.00 | 3.89 |
| 7 | 830946 | 森萱医药 | 1,290,000 | 9,739,500.00 | 3.69 |
| 8 | 831195 | 三祥科技 | 1,060,000 | 8,151,400.00 | 3.09 |
| 9 | 430139 | 华岭股份 | 745,289 | 7,914,969.18 | 3.00 |
| 10 | 839725 | 惠丰钻石 | 470,158 | 7,536,632.74 | 2.86 |
| 11 | 835179 | 凯德石英 | 300,041 | 6,912,944.64 | 2.62 |
| 12 | 430476 | 海能技术 | 324,886 | 4,428,196.18 | 1.68 |
| 13 | 430047 | 诺思兰德 | 320,000 | 4,384,000.00 | 1.66 |
| 14 | 835985 | 海泰新能 | 600,000 | 3,888,000.00 | 1.47 |
| 15 | 872351 | 华光源海 | 660,000 | 3,649,800.00 | 1.38 |
| 16 | 833429 | 康比特 | 520,000 | 3,458,000.00 | 1.31 |
| 17 | 838171 | 邦德股份 | 320,031 | 2,889,879.93 | 1.10 |
| 18 | 835892 | 中科美菱 | 320,082 | 2,864,733.90 | 1.09 |
| 19 | 835670 | 数字人 | 240,244 | 2,524,964.44 | 0.96 |
| 20 | 831855 | 浙江大农 | 360,031 | 2,322,199.95 | 0.88 |
| 21 | 832023 | 田野股份 | 800,000 | 2,312,000.00 | 0.88 |
| 22 | 838262 | 太湖雪 | 225,063 | 1,958,048.10 | 0.74 |
| 23 | 870199 | 倍益康 | 145,600 | 1,860,768.00 | 0.71 |
| 24 | 831726 | 朱老六 | 160,000 | 1,612,800.00 | 0.61 |
| 25 | 873122 | 中纺标 | 120,000 | 1,504,800.00 | 0.57 |
| 26 | 836826 | 盖世食品 | 228,000 | 1,409,040.00 | 0.53 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 27 | 833819 | 颖泰生物 | 260,000 | 1,219,400.00 | 0.46 |
| 28 | 839167 | 同享科技 | 100,000 | 1,188,000.00 | 0.45 |
| 29 | 831832 | 科达自控 | 90,547 | 1,066,643.66 | 0.40 |
| 30 | 831445 | 龙竹科技 | 217,560 | 1,063,868.40 | 0.40 |
| 31 | 832419 | 路斯股份 | 134,100 | 925,290.00 | 0.35 |
| 32 | 837212 | 智新电子 | 70,000 | 354,900.00 | 0.13 |

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 | 834033 | 康普化学 | 15,090,962.51 | 5.69 |
| 2 | 831152 | 昆工科技 | 14,642,548.15 | 5.52 |
| 3 | 836077 | 吉林碳谷 | 13,726,845.88 | 5.18 |
| 4 | 839371 | 欧福蛋业 | 12,054,265.29 | 4.55 |
| 5 | 430425 | 乐创技术 | 11,212,470.59 | 4.23 |
| 6 | 838402 | 硅烷科技 | 11,146,906.72 | 4.21 |
| 7 | 830946 | 森萱医药 | 9,633,204.64 | 3.63 |
| 8 | 839725 | 惠丰钻石 | 8,537,134.50 | 3.22 |
| 9 | 430139 | 华岭股份 | 7,031,035.98 | 2.65 |
| 10 | 835179 | 凯德石英 | 6,809,690.66 | 2.57 |
| 11 | 430476 | 海能技术 | 5,028,939.39 | 1.90 |
| 12 | 835985 | 海泰新能 | 4,500,935.46 | 1.70 |
| 13 | 833429 | 康比特 | 4,016,302.87 | 1.52 |
| 14 | 832023 | 田野股份 | 3,318,509.24 | 1.25 |
| 15 | 430047 | 诺思兰德 | 3,193,169.79 | 1.20 |
| 16 | 838171 | 邦德股份 | 2,965,184.37 | 1.12 |
| 17 | 870199 | 倍益康 | 2,796,210.58 | 1.05 |
| 18 | 831195 | 三祥科技 | 2,631,431.99 | 0.99 |
| 19 | 831855 | 浙江大农 | 2,522,641.91 | 0.95 |

| | | | | |
|----|--------|-----|--------------|------|
| 20 | 838262 | 太湖雪 | 2,204,509.22 | 0.83 |
|----|--------|-----|--------------|------|

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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 | 834033 | 康普化学 | 12,367,410.22 | 4.67 |

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 | 159,238,391.23 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 12,367,410.22 |

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，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 | 117,651.17 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 117,651.17 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

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 | 持有 | 户均持有 | 持有人结构 |
|----|----|------|-------|
|----|----|------|-------|

| 级别 | 户数(户) | 的基金份额 | 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 |
| 中信建投北交所精选两年定期混合A | 9,263 | 23,805.42 | 3,203,643.35 | 1.4528% | 217,305,941.34 | 98.5472% |
| 中信建投北交所精选两年定期混合C | 2,520 | 18,451.13 | 175,009.50 | 0.3764% | 46,321,849.44 | 99.6236% |
| 合计 | 11,688 | 22,844.49 | 3,378,652.85 | 1.2654% | 263,627,790.78 | 98.7346% |

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 | 中信建投北交所精选两年定期混合A | 1,216,358.07 | 0.5516% |
| | 中信建投北交所精选两年定期混合C | 64,505.37 | 0.1387% |
| | 合计 | 1,280,863.44 | 0.4797% |

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 | 中信建投北交所精选两年定开混合A | >100 |
| | 中信建投北交所精选两年定开混合C | 0~10 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 中信建投北交所精选两年定开混合A | 0 |
| | 中信建投北交所精选两年定开混合C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 中信建投北交所精选两年定开混合A | 中信建投北交所精选两年定开混合C |
|----------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2022年08月16日)基金份额总额 | 220,509,584.69 | 46,496,858.94 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 220,509,584.69 | 46,496,858.94 |
| 本报告期基金总申购份额 | - | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - | - |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 220,509,584.69 | 46,496,858.94 |

§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

本报告期内，高翔先生于2023年1月12日离任基金管理人副总经理、首席信息官，王欢女士于2023年3月31日起担任基金管理人财务负责人；

本报告期内，基金管理人因第三届董事会任期届满，第四届董事会成员调整变动，基金管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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，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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变更。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 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，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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 | |
| 财通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------|---|----------------|---------|-----------|---------|---|
| 证券 | | | | | | |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | 171,605,801.45 | 100.00% | 94,380.25 | 100.00% | - |
| 中信建投证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字（2007）48号）的规定及本基金管理人的《中信建投基金管理有限公司公募基金交易单元管理办法》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）证券经纪商的选择由公司权益投资一部负责人根据证券经纪商投资研究服务综合评价，作出交易单元开设或撤销的相关决定。经公司分管领导通过后，方可办理相关的交易单元开设或撤销事宜。

（2）权益投资一部每季度组织公募投研条线人员完成对各往来证券经纪商的研究服务评估。根据评估结果调整确定个别证券经纪商的交易金额及比率限制的参考。

（3）评估实行评分制，具体如下：

分配权重（100分）=基础研究服务（70%）+综合研究服务（20%）+特别研究服务（10%）。基础研究服务占70%权重和综合研究服务占20%权重，由公募投研条线人员进行打分；特别研究服务占10%权重，由系统跟踪股票涨跌幅后生成得分。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

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高级管理人员变更公告 | 规定网站、规定报刊 | 2023-01-13 |
| 2 | 中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年第4季度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2023-01-20 |
| 3 | 中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金2022年第4季度报告 | 规定网站 | 2023-01-20 |

| | | | |
|---|---|-----------|------------|
| 4 | 中信建投基金管理有限公司 董事变更公告 | 规定网站、规定报刊 | 2023-03-30 |
| 5 | 中信建投基金管理有限公司 旗下部分基金2022年年度报告 提示性公告 | 规定报刊 | 2023-03-31 |
| 6 | 中信建投北交所精选两年定期 开放混合型证券投资基金 2022年年度报告 | 规定网站 | 2023-03-31 |
| 7 | 中信建投基金管理有限公司 高级管理人员变更公告 | 规定网站、规定报刊 | 2023-04-01 |
| 8 | 中信建投基金管理有限公司 旗下部分基金2023年第1季 度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2023-04-21 |
| 9 | 中信建投北交所精选两年定期 开放混合型证券投资基金 2023年第1季度报告 | 规定网站 | 2023-04-21 |

§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、《中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投北交所精选两年定期开放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。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 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

二〇二三年八月三十一日