
中信建投致远混合型证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09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10月25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10月24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7月1日起至9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	37,000,429.85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	30,472,639.01份	6,527,790.84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07月01日 - 2024年09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	-1,909,357.75	-512,657.02
2.本期利润	2,133,139.58	341,533.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.0684	0.0425
4.期末基金资产净值	32,275,267.30	6,895,317.94
5.期末基金份额净值	1.0592	1.0563

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	7.26%	1.22%	12.52%	1.11%	-5.26%	0.11%
过去六个月	5.13%	0.96%	12.35%	0.89%	-7.22%	0.07%
自基金合同生效起至今	5.92%	0.84%	18.20%	0.85%	-12.28%	-0.01%

中信建投致远混合C净值表现

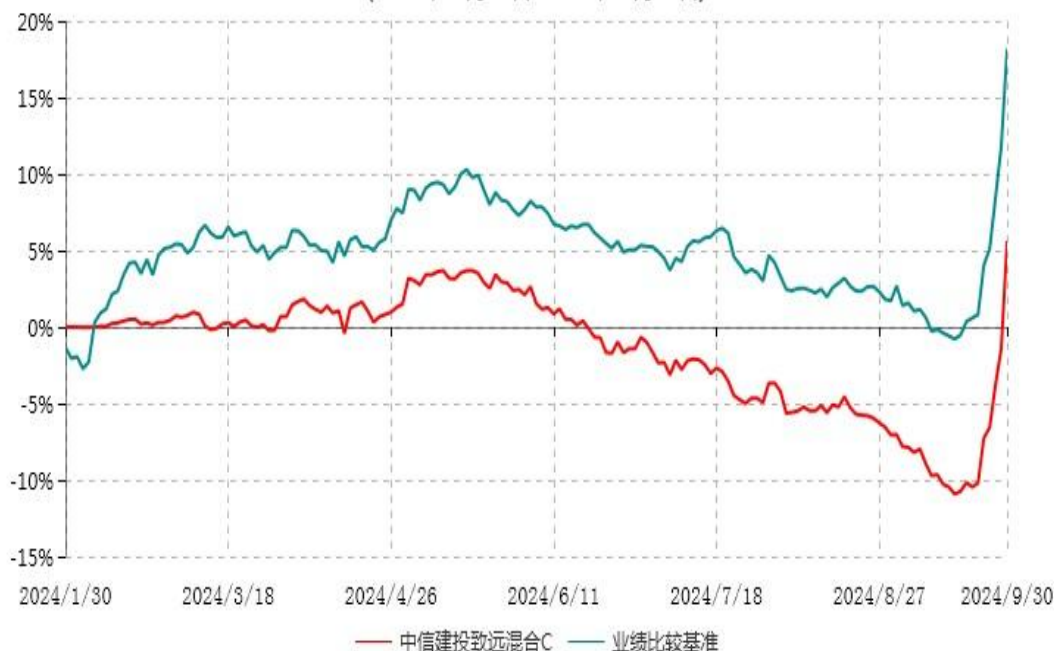
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.15%	1.22%	12.52%	1.11%	-5.37%	0.11%
过去六个月	4.92%	0.96%	12.35%	0.89%	-7.43%	0.07%
自基金合同生效起至今	5.63%	0.84%	18.20%	0.85%	-12.57%	-0.01%

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09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09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，建仓期结束后本基金的投资组合比例符合基金合同的相关约定。

§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

					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。
--	--	--	--	--	---

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

三季度A股出现重要的转变，9月最后一周中央政治局会议召开以及央行、金管局和证监会三部委联合召开《金融支持经济高质量发展有关情况》新闻发布会，市场对于A股估值修复的预期急速上升，短时间内整个市场成交量迅速放大，行情也快速攀升，9月底A股市场的日成交金额达到了2.6万亿元、沪深300、中证500、创业板指数季度涨幅分别达到16.05%、16.19%、29.21%。三季末行情的修复呈现明显的普涨特征。三季度我们秉持着追求长期稳健回报的原则，维持相对较高的权益仓位和转债仓位，但的确对于季末突然爆发的行情准备不足，产品在弹性上相对落后，这种阶段性机会在我们追求控制波动的情况下，难以避免被错过。

展望四季度，市场已经相对充分预期的是国内将不断推出维护经济增速的政策，响应“切实增强做好经济工作的责任感和紧迫感”，对财政、货币以及地产方面的政策预期达到一个相对极致的状态，在此预期之下，A股市场的波动也难以避免的进入到一个极端的情况。同时不能忽视的外部风险包括海外通胀的反复、美联储降息节奏的变化、美国大选风险的外溢，以及持续不断的地缘政治风险，通过汇率、外需对我国经济产生的客观负面影响，短时间依然会持续。考虑到A股短期快速反弹后，部分行业已经脱离了历史估值的低位，后期在国内经济逐步恢复、海外风险依然扰动的背景下，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1.0592元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为7.26%，同期业绩比较基准收益率为12.52%；截至报告期末中信建投致远混合C基金份额净值为1.0563元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为7.15%，同期业绩比较基准收益率为12.52%。

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。

本基金本报告期内出现超过连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，基金管理人已向中国证监会报送了相关解决方案的报告。自2024年8月23日起，本基金迷你期间的审计费、信息披露费和银行间账户维护费等相关固定费用由基金管理人固有资金承担。

§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	32,511,410.16	82.72
	其中：股票	32,511,410.16	82.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,105,347.61	7.90
	其中：债券	3,105,347.61	7.90
	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	700,000.00	1.78
	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	2,985,354.44	7.60
8	其他资产	500.00	0.00
9	合计	39,302,612.21	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	232,098.00	0.59
B	采矿业	834,829.40	2.13
C	制造业	19,193,549.44	49.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,808,945.00	4.62
E	建筑业	863,623.00	2.20
F	批发和零售业	129,757.80	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	2,236,378.00	5.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,060,387.30	2.71
J	金融业	4,862,413.00	12.41

K	房地产业	474,944.00	1.21
L	租赁和商务服务业	307,054.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	248,180.22	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	145,107.00	0.37
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	114,144.00	0.29
S	综合	-	-
	合计	32,511,410.16	83.00

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	600064	南京高科	65,600	474,944.00	1.21
2	600887	伊利股份	15,200	441,864.00	1.13
3	600585	海螺水泥	15,200	397,328.00	1.01
4	600741	华域汽车	19,800	355,014.00	0.91
5	600820	隧道股份	51,000	337,620.00	0.86
6	600219	南山铝业	76,800	336,384.00	0.86
7	601229	上海银行	42,400	334,536.00	0.85
8	601398	工商银行	53,800	332,484.00	0.85
9	002001	新和成	14,700	331,779.00	0.85
10	601169	北京银行	55,500	324,120.00	0.83

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）	3,105,347.61	7.93
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,105,347.61	7.93

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	3,700	404,992.07	1.03
2	118031	天23转债	3,500	299,645.69	0.76
3	113524	奇精转债	2,290	259,483.60	0.66
4	113037	紫银转债	2,260	243,817.50	0.62
5	127016	鲁泰转债	2,040	226,869.24	0.58

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）	-123,571.92
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

本基金管理人根据风险管理原则，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。

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，兴业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福建监管局的处罚，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。

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	500.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	500.00

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	404,992.07	1.03
2	118031	天23转债	299,645.69	0.76
3	113524	奇精转债	259,483.60	0.66
4	113037	紫银转债	243,817.50	0.62
5	127016	鲁泰转债	226,869.24	0.58
6	128129	青农转债	223,374.70	0.57
7	113545	金能转债	218,158.36	0.56
8	127042	嘉美转债	213,462.50	0.54
9	113056	重银转债	192,512.39	0.49
10	113530	大丰转债	189,919.35	0.48
11	113054	绿动转债	188,281.23	0.48
12	127017	万青转债	188,259.17	0.48
13	128134	鸿路转债	184,964.47	0.47
14	110062	烽火转债	48,616.40	0.12
15	113526	联泰转债	22,990.94	0.06

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	32,220,231.34	10,006,697.64
报告期期间基金总申购份额	10,802.22	1,078.35
减：报告期期间基金总赎回份额	1,758,394.55	3,479,985.15
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	30,472,639.01	6,527,790.84

§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	20240701-20240930	19,266,859.34	-	-	19,266,859.34	52.0720%
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》，本次基金份额持有人大会于2024年7月15日表决通过了《关于中信建投致远混合型证券投资基金修改基金合同的议案》，本次基金份额持有人大会决议自2024年7月15日起生效。

§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10月25日