
中信建投睿选6个月持有期混合型基金中基金（FOF）

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：北京银行股份有限公司

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。

基金托管人北京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	中信建投睿选6个月持有混合（FOF）
基金主代码	013844
基金运作方式	契约型开放式、对每份基金份额设置6个月的最短持有期
基金合同生效日	2021年11月02日
报告期末基金份额总额	145,174,165.82份
投资目标	本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额，在保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用自上而下的策略，通过对宏观经济基本面（包括经济运行周期、财政及货币政策、产业政策等）的分析判断，和对流动性水平（包括资金面供需情况、证券市场估值水平等）的深入研究，并结合国内外先进资产配置理念，及时把握市场时机，调整资产配置比例，力争实现基金资产的长期增值。 在基金投资方面，基于本基金管理人对全市场基金公司及其管理的基金的研究和评级体系，在有效控制风险的前提下，通过定量和定性相结合的方法，

	精选管理规范、业绩优良的基金公司管理的基金，以分享资本市场的成长。	
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%	
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，本基金的预期风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。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。	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
下属各类别基金的基金简称	中信建投睿选6个月持有混合（FOF）A	中信建投睿选6个月持有混合（FOF）C
下属各类别基金的交易代码	013844	013845
报告期末下属各类别基金的份额总额	98,305,049.30份	46,869,116.52份

注：根据基金管理人于2024年9月30日披露的《关于中信建投睿选6个月持有期混合型基金中基金（FOF）变更业绩比较基准并修订基金合同及托管协议的公告》《中信建投睿选6个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》，自2024年9月30日起，本基金的业绩比较基准由“70%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）”变更为“中证偏股型基金指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%”。

§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)	
	中信建投睿选6个月持有混合（FOF）A	中信建投睿选6个月持有混合（FOF）C
1.本期已实现收益	-2,703,190.18	-1,306,860.39
2.本期利润	1,785,965.46	809,656.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0177	0.0168
4.期末基金资产净值	73,530,473.98	34,648,208.42
5.期末基金份额净值	0.7480	0.7393

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

中信建投睿选6个月持有混合（FOF）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	2.72%	1.10%	13.34%	1.25%	-10.62%	-0.15%
过去六个月	4.16%	0.90%	12.16%	0.97%	-8.00%	-0.07%
过去一年	1.33%	0.86%	9.96%	0.83%	-8.63%	0.03%
自基金合同生效起至今	-25.20%	0.91%	-7.34%	0.79%	-17.86%	0.12%

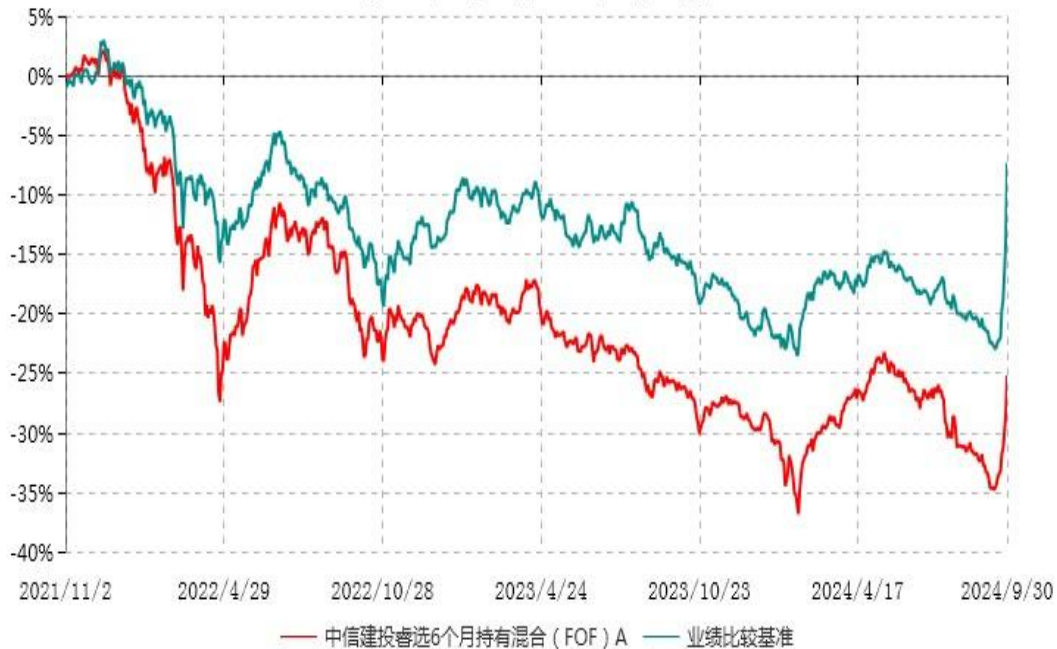
中信建投睿选6个月持有混合（FOF）C净值表现

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	2.62%	1.10%	13.34%	1.25%	-10.72%	-0.15%
过去六个月	3.98%	0.90%	12.16%	0.97%	-8.18%	-0.07%
过去一年	0.91%	0.86%	9.96%	0.83%	-9.05%	0.03%
自基金合同生效起至今	-26.07%	0.91%	-7.34%	0.79%	-18.73%	0.12%

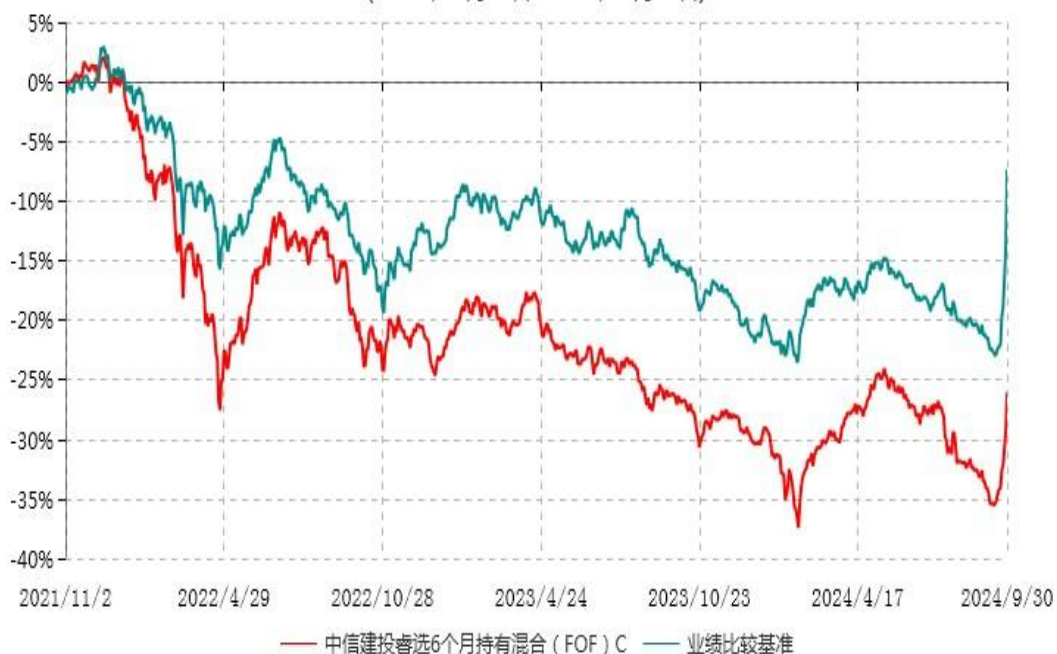
注：根据基金管理人于2024年9月30日披露的《关于中信建投睿选6个月持有期混合型基金中基金（FOF）变更业绩比较基准并修订基金合同及托管协议的公告》《中信建投睿选6个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》，自2024年9月30日起，本基金的业绩比较基准由“70%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）”变更为“中证偏股型基金指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%”。

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

中信建投睿选6个月持有混合（FOF）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
(2021年11月02日-2024年09月30日)



中信建投睿选6个月持有混合（FOF）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
(2021年11月02日-2024年09月30日)



注：根据基金管理人于2024年9月30日披露的《关于中信建投睿选6个月持有期混合型基金中基金（FOF）变更业绩比较基准并修订基金合同及托管协议的公告》《中信建投睿选6个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》，自2024年9月30日起，本基金的业绩比较基准由“70%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债指数收益率+5%×银行活期

存款利率（税后）”变更为“中证偏股型基金指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%”。

§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		
刘宁	本基金的基金经理	2021-11-02	-	9年	中国籍，1984年6月生，北京工业大学光学专业硕士。曾任天相投顾投资分析部TMT组组长、建信人寿资产管理部权益投资专员、嘉合基金权益投资二部拟任基金经理。2015年7月加入中信建投基金管理有限公司，曾任投资部基金经理、研究部研究员、特定资产管理部资深经理、FOF投资部基金经理，现任本公司多元资产配置部基金经理，担任中信建投睿选6个月持有期混合型基金中基金（FOF）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 报告期内基金的投资策略和运作分析

第三季度沪深300指数上涨16.07%，创业板指数上涨29.21%，恒生指数上涨19.27%，标普500指数上涨5.53%，偏股混合型基金指数上涨10.68%。第三季度海外和国内市场都发生了较大的波动，以下是本季度的主要操作和看法：

第一，全球主要经济体（除日本外）开始竞争性降息，美联储首次降息50BP略超预期，美国经济周期处于中后阶段，通过降息拖延衰退到来的时间，但最终衰退无法避免。值得关注的是，本季度日本发生了套息交易平仓，引发多个市场剧烈波动，我们无法估计还有多少存量结构化产品，基于此种情景收缩海外配置，陆续卖出非美地区的权益配置。

第二，债券市场也出现了波动，主要受资金流动、投资者预期等影响，利率短期下降到位，红利的逻辑基本演绎结束。

第三，大能源板块仍超配，短期、中长期都有配置需求，煤炭、石油石化调整后择机配置，有色仍要通过结构控制波动率。

第四，银行股估值徐徐向上，我们选择基本面良好的小市值银行进行配置。

第五，我们仍保持低估值港股的配置，全球来看港股的短期大涨属于补涨，当前标配港股。机构观点比较一致的时候我们相对谨慎一点。

9月底市场迎来一波大涨，主要指数波动率非常大，投机氛围浓厚不影响我们的布局节奏，我们大部分操作按计划进行，保持定力多看少动。

本基金将继续保持“稳中求进”的风格，坚持“均衡、择优、灵活”的原则下，通过增加基金配置的精准度，改善投资效果。本基金变更业绩比较基准后不必再赘述投资策略与基准的差异，将尽力排除不利因素发挥FOF投资的优势。

在此感谢各位持有人的耐心和支持！

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投睿选6个月持有混合（FOF）A基金份额净值为0.7480元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.72%，同期业绩比较基准收益率为13.34%；截

至报告期末中信建投睿选6个月持有混合（FOF）C基金份额净值为0.7393元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.62%，同期业绩比较基准收益率为13.34%。

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 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	6,289,078.00	5.78
	其中：股票	6,289,078.00	5.78
2	基金投资	95,301,764.55	87.65
3	固定收益投资	6,293,439.95	5.79
	其中：债券	6,293,439.95	5.79
	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	805,130.31	0.74
8	其他资产	41,227.46	0.04
9	合计	108,730,640.27	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	-	-
B	采矿业	1,647,000.00	1.52
C	制造业	1,726,778.00	1.60
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	1,372,000.00	1.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,543,300.00	1.43
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	-	-
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	6,289,078.00	5.81

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	601728	中国电信	230,000	1,543,300.00	1.43
2	601006	大秦铁路	200,000	1,372,000.00	1.27
3	002475	立讯精密	20,000	869,200.00	0.80
4	603195	公牛集团	10,300	857,578.00	0.79
5	600028	中国石化	120,000	835,200.00	0.77
6	601857	中国石油	90,000	811,800.00	0.75

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	6,293,439.95	5.82
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,293,439.95	5.82

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	019733	24国债02	62,000	6,293,439.95	5.82

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

无。

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。

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	41,227.46
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	41,227.46

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

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 基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值(元)	占基金 资产净 值比例 (%)	是否 属于 基金 管理人及 管理人关 联方
----	------	------	------	-------------	---------	--------------------------	--------------------------------------

							所管理的基金
1	000893	工银创新动力股票	契约型开放式	9,282,467.85	11,009,006.87	10.18	否
2	011066	大成高新技术产业股票C	契约型开放式	2,468,353.53	10,917,280.83	10.09	否
3	002207	前海开源金银珠宝混合C	契约型开放式	6,658,005.85	10,539,623.26	9.74	否
4	260117	景顺长城支柱产业混合A	契约型开放式	5,431,771.27	10,043,345.08	9.28	否
5	004317	前海开源沪港深裕鑫C	契约型开放式	7,513,737.35	9,837,736.31	9.09	否
6	012160	财通资管健康产业混合C	契约型开放式	8,448,235.35	7,728,445.70	7.14	否
7	560880	广发中证全指家用电器ETF	交易型开放式	5,500,000.00	7,524,000.00	6.96	否
8	000754	华宝量化对冲混合C	契约型开放式	5,378,680.21	5,937,525.08	5.49	否
9	513500	博时标普500ETF	交易型开放式	2,800,000.00	5,342,400.00	4.94	否
10	007020	华安添鑫中短债C	契约型开放式	3,754,274.47	4,341,818.42	4.01	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用2024年07月01日至 2024年09月30日	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申	-	-

购费（元）		
当期交易基金产生的赎回费（元）	14,663.34	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	37,232.73	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	256,473.85	4,825.53
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	43,702.98	804.19
当期交易基金产生的交易费（元）	29,308.71	-
当期交易基金产生的转换费（元）	100,790.57	-

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。根据本基金合同的约定，本基金基金财产中投资于本基金管理人管理的其他基金份额的部分不收取管理费，本基金基金财产中投资于本基金托管人托管的其他基金份额的部分不收取托管费。

本基金管理人运用本基金财产申购、赎回其自身管理的其他基金（ETF除外），应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并计入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，当期交易基金产生的赎回费为按规定应当收取并计入被投资基金其他收入部分的赎回费。交易及持有基金管理人所管理基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投睿选6个月持有混合（FOF）A	中信建投睿选6个月持有混合（FOF）C
报告期期初基金份额总额	102,829,621.32	50,070,580.45
报告期期间基金总申购份额	114,584.60	198,275.68

减：报告期期间基金总赎回份额	4,639,156.62	3,399,739.61
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	98,305,049.30	46,869,116.52

§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

本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

8.2 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。

§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

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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2024年9月30日披露《关于中信建投睿选6个月持有期混合型基金中基金（FOF）变更业绩比较基准并修订基金合同及托管协议的公告》《中信建投睿选6个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》《中信建投睿选6个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投睿选6个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《中信建投睿选6个月持有期混合型基金中基金（FOF）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。

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

10.3 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