

---

中信建投臻选成长混合型发起式证券投资基金

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: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	中信建投臻选成长混合发起式
基金主代码	018788
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年08月08日
报告期末基金份额总额	36,955,168.45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	本基金的股票投资主要采用“自下而上”的策略，通过定性与定量相结合的选股方法，精选具有长期持续成长性且估值相对合理的成长型上市公司作为主要投资对象，同时结合“自上而下”的行业分析和风格配置，构建行业适度集中和风格配置均衡的股票组合。综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置，确定资产的配置比例。
业绩比较基准	中证800指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中证综合债指数收益率×20%

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	北京银行股份有限公司	
下属各类别基金的基金简称	中信建投臻选成长混合发起式A	中信建投臻选成长混合发起式C
下属各类别基金的交易代码	018788	018789
报告期末下属各类别基金的份额总额	11,673,701.07份	25,281,467.38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)	
	中信建投臻选成长混合发起式A	中信建投臻选成长混合发起式C
1.本期已实现收益	-212,411.39	-494,902.54
2.本期利润	2,175,506.41	4,640,424.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.1862	0.1796
4.期末基金资产净值	12,111,177.62	26,107,523.51
5.期末基金份额净值	1.0375	1.0327

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

中信建投臻选成长混合发起式A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④
----	--------	----------	----------	----------	-----	-----

		②	率③	率标准差④		
过去三个月	21.92%	2.51%	13.31%	1.25%	8.61%	1.26%
过去六个月	8.08%	2.12%	12.02%	1.01%	-3.94%	1.11%
过去一年	4.16%	1.85%	8.38%	0.91%	-4.22%	0.94%
自基金合同生效起至今	3.75%	1.72%	1.72%	0.89%	2.03%	0.83%

中信建投臻选成长混合发起式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	21.80%	2.50%	13.31%	1.25%	8.49%	1.25%
过去六个月	7.88%	2.12%	12.02%	1.01%	-4.14%	1.11%
过去一年	3.74%	1.85%	8.38%	0.91%	-4.64%	0.94%
自基金合同生效起至今	3.27%	1.72%	1.72%	0.89%	1.55%	0.83%

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

中信建投臻选成长混合发起式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  
(2023年08月08日-2024年09月30日)



中信建投臻选成长混合发起式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  
(2023年08月08日-2024年09月30日)



## §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		
张青	本基金的基金经理	2023-08-08	-	20年	中国籍，1978年10月生，北京大学光华管理学院金融学硕士。曾任国泰基金管理有限公司研究员，易方达基金管理有限公司投资经理助理，华夏基金管理有限公司投资经理，工银瑞信基金管理有限公司专户投资部权益投资负责人、投资副总监、投资经理，北京嘉数资产管理有限公司研究总监。2021年1月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司权益投资一部基金经理，担任中信建投臻选成长混

					合型发起式证券投资基金 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非公平交易的情况。

##### 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

2024年三季度，国内制造业PMI指数在低位震荡，国内经济延续低位徘徊的态势，只有出口仍是经济中较为明显的亮点，但是又将面临各国关税等贸易保护主义政策冲击。7月召开的三中全会推出一系列改革措施，随后7月末召开的中央政治局会议对当前经济形势判断谨慎，继续强调加大政策力度刺激经济。9月底召开的中央政治局会议提出有效落实存量政策，加力推出增量政策，这意味着政策大转向。美联储9月份议息会议开始新一轮降息周期，并且首次超预期降息50个基点，这为国内市场创造了良好的外部流动性环境。美股三季度继续震荡走高，道指、标普500指数继续创出新的历史新高。在此背景下，国内市场7月初以来继续震荡下行，主要指数都接近今年1月底股灾时的历史低点，部分指数甚至创出历史新低，直到9月下旬开始反转式上涨。我们管理的组合净值因而经历过山车式波动，较为幸运的是组合净值在9月底创出成立以来的新高。展望未来一个时期，国内经济将触底回升，政策对科技创新的支持在明显加大，美股科技

股浪潮外溢效应将逐步显现，国内市场与全球市场有望逐步接轨，比去年有更明显的投资机会。基于此，组合将维持中性偏高的权益仓位，积极参与结构性投资机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投臻选成长混合发起式A基金份额净值为1.0375元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为21.92%，同期业绩比较基准收益率为13.31%；截至报告期末中信建投臻选成长混合发起式C基金份额净值为1.0327元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为21.80%，同期业绩比较基准收益率为13.31%。

#### 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	34,847,741.79	90.91
	其中：股票	34,847,741.79	90.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,839,757.81	4.80
	其中：债券	1,839,757.81	4.80
	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	1,543,827.08	4.03
8	其他资产	99,232.81	0.26
9	合计	38,330,559.49	100.00

注：本基金本报告期末通过深港通机制投资香港股票的公允价值为864,906.79元，占基金资产净值比例为2.26%。

#### 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	-	-
C	制造业	22,402,155.00	58.62
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	697,270.00	1.82
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,735,960.00	17.62
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,614,400.00	4.22
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,783,650.00	4.67
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	749,400.00	1.96
S	综合	-	-
	合计	33,982,835.00	88.92

### 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(%)
信息技术	864,906.79	2.26
合计	864,906.79	2.26

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	688111	金山办公	15,000	3,996,000.00	10.46
2	688195	腾景科技	69,000	2,003,070.00	5.24
3	688036	传音控股	18,000	1,942,740.00	5.08
4	688408	中信博	23,000	1,931,080.00	5.05
5	688041	海光信息	18,000	1,859,040.00	4.86
6	300394	天孚通信	18,000	1,809,000.00	4.73
7	688372	伟测科技	33,000	1,783,650.00	4.67
8	688302	海创药业	48,000	1,723,200.00	4.51
9	835179	凯德石英	91,000	1,688,960.00	4.42
10	300502	新易盛	12,500	1,624,625.00	4.25

#### 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	1,839,757.81	4.81
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	1,839,757.81	4.81

#### 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	019727	23国债24	18,000	1,839,757.81	4.81

#### 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，本基金投资的前十名证券的发行主体中，深圳传音控股股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市住房和建设局的处罚。

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	14,734.83
2	应收证券清算款	61,213.26
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	23,284.72
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	99,232.81

### 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 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投臻选成长混合 发起式A	中信建投臻选成长混合 发起式C
报告期期初基金份额总额	11,758,473.09	26,864,813.11
报告期期间基金总申购份额	28,020.59	38,522.43
减：报告期期间基金总赎回份额	112,792.61	1,621,868.16
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	11,673,701.07	25,281,467.38

## §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

单位：份

	中信建投臻选成长混 合发起式A	中信建投臻选成长混 合发起式C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,811.29	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,811.29	-
报告期期末持有的本基金份额占基金 总份额比例(%)	85.6782	-

### 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,811.29	27.0647%	10,001,811.29	27.0647%	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,001,811.29	27.0647%	10,001,811.29	27.0647%	-

### §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

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	10,001,811.29	-	-	10,001,811.29	27.0647%

#### 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。

#### 9.2 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。

### §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、《中信建投臻选成长混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投臻选成长混合型发起式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。

### 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