

# 中信建投稳利混合型证券投资基金

## 2025 年第 2 季度报告

2025 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:北京银行股份有限公司

报告送出日期:2025 年 07 月 21 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2025年07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2025年04月01日起至2025年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

|                 |                                                                                                                                                       |                |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|
| 基金简称            | 中信建投稳利                                                                                                                                                |                |
| 基金主代码           | 000804                                                                                                                                                |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                                                                                                                                                |                |
| 基金合同生效日         | 2018 年 10 月 18 日                                                                                                                                      |                |
| 报告期末基金份额总额      | 46,577,376.97 份                                                                                                                                       |                |
| 投资目标            | 本基金主要投资于股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具，通过科学的资产配置与严谨的风险管理，力争超越业绩比较基准、实现基金资产持续稳定增值。                                                                              |                |
| 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，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，并据此对本基金资产在股票、债券、现金之间的投资比例进行动态调整。 |                |
| 业绩比较基准          | 沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富指数收益率×80%                                                                                                                       |                |
| 风险收益特征          | 本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。                                                                                                           |                |
| 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                                                                                                                                            |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 中信建投稳利 A                                                                                                                                              | 中信建投稳利 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 000804                                                                                                                                                | 006844         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 40,126,097.61 份                                                                                                                                       | 6,451,279.36 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（2025 年 04 月 01 日-2025 年 06 月 30 日） |              |
|-----------------|----------------------------------------|--------------|
|                 | 中信建投稳利 A                               | 中信建投稳利 C     |
| 1. 本期已实现收益      | 170,972.24                             | -39,040.45   |
| 2. 本期利润         | 738,598.97                             | 15,017.84    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0204                                 | 0.0016       |
| 4. 期末基金资产净值     | 53,609,800.72                          | 7,945,768.30 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.3360                                 | 1.2317       |

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

中信建投稳利 A

| 阶段            | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|---------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月         | 1.14%      | 0.68%         | 1.54%          | 0.18%                 | -0.40% | 0.50% |
| 过去六个月         | 4.65%      | 0.60%         | 0.71%          | 0.19%                 | 3.94%  | 0.41% |
| 过去一年          | 9.67%      | 0.68%         | 7.19%          | 0.26%                 | 2.48%  | 0.42% |
| 过去三年          | 7.46%      | 0.50%         | 10.75%         | 0.21%                 | -3.29% | 0.29% |
| 过去五年          | 18.70%     | 0.47%         | 20.11%         | 0.23%                 | -1.41% | 0.24% |
| 自基金转型日<br>起至今 | 29.24%     | 0.44%         | 38.59%         | 0.24%                 | -9.35% | 0.20% |

中信建投稳利 C

| 阶段     | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|--------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月  | 1.04%      | 0.69%         | 1.54%          | 0.18%                 | -0.50% | 0.51% |
| 过去六个月  | 4.45%      | 0.60%         | 0.71%          | 0.19%                 | 3.74%  | 0.41% |
| 过去一年   | 9.24%      | 0.68%         | 7.19%          | 0.26%                 | 2.05%  | 0.42% |
| 过去三年   | 6.17%      | 0.50%         | 10.75%         | 0.21%                 | -4.58% | 0.29% |
| 过去五年   | 16.35%     | 0.47%         | 20.11%         | 0.23%                 | -3.76% | 0.24% |
| 自基金转型日 | 23.17%     | 0.46%         | 28.00%         | 0.23%                 | -4.83% | 0.23% |

|     |  |  |  |  |  |  |
|-----|--|--|--|--|--|--|
| 起至今 |  |  |  |  |  |  |
|-----|--|--|--|--|--|--|

3.2.2 自基金转型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



注：1、本基金由中信建投稳利保本混合型证券投资基金转型而来，并于 2018 年 10 月 18 日合同生效。

2、以上第 1 张图为中信建投稳利 A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图，绘图日期为 2018 年 10 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日。以上第 2 张图为中信建投稳利 C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图，绘图日期为 2019 年 06 月 24 日（首笔份额登记日）至 2025 年 06 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<br>理期限 |      | 证<br>券<br>从<br>业<br>年<br>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 | 2023-08-11      | -    | 13 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、中信建投上证科创板综合指数增强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合规守信情况的说明

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

二季度，虽然中国经济受到了特朗普关税的冲击，但是仍然保持了稳健增强的趋势，制造业 PMI 在经历 4 月关税冲击后回落，至 6 月反弹到 49.7%。在“两新”等消费政策支持下，二季度国内消费稳步复苏，社零同比增幅温和扩张。海外方面，市场上对美联储首次降息的时间点调整到 9 月，预期全年降息 2 次到 4 次。美债收益率震荡小幅上升，美股走势强劲并创出历史新高。A 股在 4 月初受到关税冲击出现快速回撤，其后持续回升恢复到 2022 年 4 月以来的高点，当前仍然在上行趋势中。银行、军工、新消费和创新药在二季度都有阶段性强势表现，尤其是银行二季度上涨 12.62%，并持续创出历史新高。微盘股和北证为代表的小市值，以景气度投资为代表的成长因子表现优异。跟股市表现不同，十年国债活跃券的利率水平出现明显下行，已经重新接近历史低位。

展望 2025 年三季度，中国已经和美国签署了对等关税的框架协议，特朗普对全球其他国家的对等关税政策可能于三季度最终落地，市场预测美联储今年的首次降息可能在 9 月或者更晚。同时国内十年国债利率已经接近前低，人民币兑美元汇率也有所走强，所以海外形势可能不会对国内政策形成显著制约，国内政策可能仍然“以我为主”。国内经济在三季度可能会进一步复苏，随着关税政策落地出口继续修复，同时在“两新”等政策支持下消费也会继续复苏。预期更多行业将在 2025 年出现盈利拐点。维持对权益的风险偏好较优的判断，全年各个板块可能都会有表现机会。

可转债方面，三季度可能会继续消化一季度部分过高的估值，所以组合中我们会更为关注财报景气向上、估值合理的平衡型品种，适度参与具有估值优势的景气向上的股票标的，替代高价、高溢价的转债品种。

本基金遵从“长期可持续盈利”的投资之道，以绝对收益为目标，优化了可转债的投资仓位，看好可转债资产在经济企稳反弹过程中的高收益风险比，同时增加配置估值合理、景气向好的股票组合，回避配置高价、高溢价的品种。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投稳利 A 基金份额净值为 1.3360 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.14%，同期业绩比较基准收益率为 1.54%；截至报告期末中信建投稳利 C 基金份额净值为 1.2317 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.04%，同期业绩比较基准收益率为 1.54%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期末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              | 7,525,884.49  | 11.22         |
|    | 其中：股票             | 7,525,884.49  | 11.22         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 48,670,868.54 | 72.55         |
|    | 其中：债券             | 48,670,868.54 | 72.55         |
|    | 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          | 1,300,000.00  | 1.94          |
|    | 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      | 9,516,783.85  | 14.19         |
| 8  | 其他资产              | 70,087.87     | 0.10          |
| 9  | 合计                | 67,083,624.75 | 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         | 87,472.00    | 0.14          |
| B  | 采矿业              | 171,183.00   | 0.28          |
| C  | 制造业              | 5,909,425.49 | 9.60          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 150,672.00   | 0.24          |
| E  | 建筑业              | 175,700.00   | 0.29          |
| F  | 批发和零售业           | 54,740.00    | 0.09          |

|   |                 |              |       |
|---|-----------------|--------------|-------|
| 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 | 330,848.00   | 0.54  |
| J | 金融业             | -            | -     |
| K | 房地产业            | 101,001.00   | 0.16  |
| L | 租赁和商务服务业        | 173,152.00   | 0.28  |
| M | 科学研究和技术服务业      | -            | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 61,608.00    | 0.10  |
| 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       | 310,083.00   | 0.50  |
| S | 综合              | -            | -     |
|   | 合计              | 7,525,884.49 | 12.23 |

#### 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  | 002170 | 芭田股份 | 16,600 | 170,150.00 | 0.28         |
| 2  | 688196 | 卓越新能 | 3,261  | 156,756.27 | 0.25         |
| 3  | 002393 | 力生制药 | 8,000  | 152,480.00 | 0.25         |
| 4  | 600757 | 长江传媒 | 14,900 | 138,272.00 | 0.22         |
| 5  | 300196 | 长海股份 | 11,000 | 134,200.00 | 0.22         |
| 6  | 002970 | 锐明技术 | 2,700  | 133,380.00 | 0.22         |
| 7  | 603929 | 亚翔集成 | 3,800  | 133,380.00 | 0.22         |
| 8  | 002881 | 美格智能 | 2,800  | 129,920.00 | 0.21         |
| 9  | 605088 | 冠盛股份 | 3,400  | 128,928.00 | 0.21         |
| 10 | 603236 | 移远通信 | 1,500  | 128,700.00 | 0.21         |
| 11 | 688606 | 奥泰生物 | 1,887  | 126,806.40 | 0.21         |

#### 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） | 48,670,868.54 | 79.07 |
| 8  | 同业存单      | -             | -     |
| 9  | 其他        | -             | -     |
| 10 | 合计        | 48,670,868.54 | 79.07 |

### 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    | 16,000 | 1,991,912.11 | 3.24         |
| 2  | 123216 | 科顺转债    | 15,827 | 1,776,529.15 | 2.89         |
| 3  | 113058 | 友发转债    | 13,960 | 1,769,873.28 | 2.88         |
| 4  | 111010 | 立昂转债    | 15,320 | 1,769,397.46 | 2.87         |
| 5  | 118031 | 天 23 转债 | 16,440 | 1,726,207.66 | 2.80         |

### 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

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，浙江东南网架股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到杭州市上城区综合行政执法局、杭州市上城区笕桥街道办事处、海口市综合行政执法局秀英分局、上海市住房和城乡建设管理委员会、上海市徐汇区建设和管理委员会的处罚。

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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   | 66,320.81 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 3,767.06  |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 70,087.87 |

### 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    | 1,991,912.11 | 3.24         |
| 2  | 123216 | 科顺转债    | 1,776,529.15 | 2.89         |
| 3  | 113058 | 友发转债    | 1,769,873.28 | 2.88         |
| 4  | 111010 | 立昂转债    | 1,769,397.46 | 2.87         |
| 5  | 118031 | 天 23 转债 | 1,726,207.66 | 2.80         |
| 6  | 113048 | 晶科转债    | 1,651,918.19 | 2.68         |
| 7  | 110095 | 双良转债    | 1,638,342.17 | 2.66         |
| 8  | 127040 | 国泰转债    | 1,604,803.73 | 2.61         |
| 9  | 127089 | 晶澳转债    | 1,554,282.52 | 2.53         |
| 10 | 127103 | 东南转债    | 1,528,969.39 | 2.48         |
| 11 | 110086 | 精工转债    | 1,365,635.50 | 2.22         |
| 12 | 127038 | 国微转债    | 1,354,948.08 | 2.20         |
| 13 | 110081 | 闻泰转债    | 1,352,169.09 | 2.20         |
| 14 | 123240 | 楚天转债    | 1,153,450.54 | 1.87         |
| 15 | 123247 | 万凯转债    | 1,149,087.11 | 1.87         |
| 16 | 110093 | 神马转债    | 1,142,102.11 | 1.86         |
| 17 | 113068 | 金铜转债    | 1,099,737.57 | 1.79         |

|    |        |         |              |      |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 18 | 128081 | 海亮转债    | 1,074,366.31 | 1.75 |
| 19 | 128108 | 蓝帆转债    | 1,067,220.17 | 1.73 |
| 20 | 113033 | 利群转债    | 1,064,298.76 | 1.73 |
| 21 | 128136 | 立讯转债    | 937,189.43   | 1.52 |
| 22 | 113653 | 永 22 转债 | 889,167.15   | 1.44 |
| 23 | 110064 | 建工转债    | 888,101.56   | 1.44 |
| 24 | 127049 | 希望转 2   | 887,933.81   | 1.44 |
| 25 | 123130 | 设研转债    | 885,704.07   | 1.44 |
| 26 | 110087 | 天业转债    | 885,406.99   | 1.44 |
| 27 | 123071 | 天能转债    | 883,881.85   | 1.44 |
| 28 | 123172 | 漱玉转债    | 883,539.82   | 1.44 |
| 29 | 123168 | 惠云转债    | 883,394.80   | 1.44 |
| 30 | 127061 | 美锦转债    | 883,184.52   | 1.43 |
| 31 | 111015 | 东亚转债    | 882,531.67   | 1.43 |
| 32 | 113647 | 禾丰转债    | 882,148.89   | 1.43 |
| 33 | 127068 | 顺博转债    | 881,689.16   | 1.43 |
| 34 | 127018 | 本钢转债    | 858,189.85   | 1.39 |
| 35 | 113062 | 常银转债    | 775,363.92   | 1.26 |
| 36 | 113549 | 白电转债    | 581,771.75   | 0.95 |
| 37 | 123147 | 中辰转债    | 577,450.14   | 0.94 |
| 38 | 123128 | 首华转债    | 577,197.67   | 0.94 |
| 39 | 127052 | 西子转债    | 577,020.22   | 0.94 |
| 40 | 128130 | 景兴转债    | 576,670.55   | 0.94 |
| 41 | 123146 | 中环转 2   | 576,115.81   | 0.94 |
| 42 | 113640 | 苏利转债    | 575,145.81   | 0.93 |
| 43 | 123119 | 康泰转 2   | 573,767.87   | 0.93 |
| 44 | 123120 | 隆华转债    | 573,662.30   | 0.93 |
| 45 | 113042 | 上银转债    | 573,347.78   | 0.93 |
| 46 | 127020 | 中金转债    | 572,598.83   | 0.93 |
| 47 | 110059 | 浦发转债    | 313,441.42   | 0.51 |

#### 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

|                           | 中信建投稳利 A      | 中信建投稳利 C      |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 32,016,256.98 | 12,830,217.92 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 8,832,842.13  | 3,514,377.35  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 723,001.50    | 9,893,315.91  |
| 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               | 40,126,097.61 | 6,451,279.36  |

§ 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              | 20250522-20250630       | 6,837,976.54 | 4,203,807.05 | 0.00 | 11,041,783.59 | 23.7063% |
| 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

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 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、《中信建投稳利混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投稳利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；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 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  
二〇二五年七月二十一日