
中信建投睿选6个月持有期混合型基金中基金（FOF）

2022年第3季度报告

2022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：2022年10月26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2022年10月25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2022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	237,377,078.28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	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）	
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	155,415,527.43份	81,961,550.85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(2022年07月01日 - 2022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	-3,618,515.60	-2,017,398.09
2. 本期利润	-16,546,179.61	-8,937,530.72
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1012	-0.1008
4. 期末基金资产净值	120,990,167.01	63,573,497.74
5. 期末基金份额净值	0.7785	0.7757

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	-11.79%	0.90%	-10.48%	0.62%	-1.31%	0.28%
过去六个月	-7.97%	1.19%	-6.25%	0.83%	-1.72%	0.36%
自基金合同生效起至今	-22.15%	1.12%	-14.85%	0.84%	-7.30%	0.28%

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	-11.87%	0.90%	-10.48%	0.62%	-1.39%	0.28%
过去六个月	-8.15%	1.19%	-6.25%	0.83%	-1.90%	0.36%
自基金合同生效起至今	-22.43%	1.12%	-14.85%	0.84%	-7.58%	0.28%

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-2022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-2022年09月30日)



注：1、本基金基金合同生效于 2021 年 11 月 2 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		
刘宁	本基金的基金经理	2021-11-02	-	7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，现任本公司FOF投资部基金经理，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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

报告期内，本管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的5%的交易共1次，为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

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指数下跌15%，创业板指数下跌19%，恒生指数下跌21%，标普500指数下跌5%。在海外市场高通胀压力下，美联储采取连续加息遏制通胀，主要经济体货币均出现贬值，股票资产纷纷下跌。9月地缘政治局势也发生了变化，俄乌冲突进入第二阶段，多轮博弈后欧洲能源的保障问题仍未解决；美国扩大对华半导体制裁范围，基础科学技术国产化迫在眉睫。外部环境的不确定性较高，国内稳经济大盘的意愿逐步增强，政府逐步加码财税、货币政策，当前尚未出现明显效果，回顾历史这些工具具有一定滞后性，需耐心等待经济数据的复苏验证。

市场从7月初开始调整至今时间已有三个月，主要指数已回调至4月的低位，投资者不必悲观，我们认为正是股票组合配置的良机。短期市场波动较大，但我们认为风险不大，本基金在第三季度组合围绕“稳增长”和“高成长”双方向进行布局优化，增加“价值”风格的基金配置。三季报数据将决定全年的业绩指引，四季度的布局可依三季报进行板块间的再平衡。

展望第四季度，我们看好低估值板块的估值修复，成长方向需要挑选风格适宜的基金配置。我们看好基建、石油石化、汽车电子、智能装备、非银金融、新能源化工、医药、新消费、农业等细分赛道龙头的投资机会。

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，努力追踪偏股混合型基金指数，优化基金配置结构，提高风险收益比。

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0.7785元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.79%，同期业绩比较基准收益率为-10.48%；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0.7757元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.87%，同期业绩比较基准收益率为-10.48%。

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	23,366,687.00	12.58
	其中：股票	23,366,687.00	12.58
2	基金投资	148,046,271.38	79.73
3	固定收益投资	12,252,693.70	6.60
	其中：债券	12,252,693.70	6.60
	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	1,607,508.86	0.87
8	其他资产	402,533.01	0.22
9	合计	185,675,693.95	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	833,200.00	0.45
C	制造业	13,909,399.00	7.54
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	3,325,948.00	1.80

G	交通运输、仓储和邮政业	2,708,000.00	1.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,251,020.00	0.68
J	金融业	1,339,120.00	0.73
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	23,366,687.00	12.66

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	000963	华东医药	82,900	3,325,948.00	1.80
2	601006	大秦铁路	400,000	2,708,000.00	1.47
3	603290	斯达半导	8,000	2,592,000.00	1.40
4	603195	公牛集团	16,000	2,248,000.00	1.22
5	002475	立讯精密	63,000	1,852,200.00	1.00
6	600176	中国巨石	110,000	1,449,800.00	0.79
7	300285	国瓷材料	50,000	1,448,500.00	0.78
8	300059	东方财富	76,000	1,339,120.00	0.73
9	002353	杰瑞股份	35,000	1,142,050.00	0.62

10	002185	华天科技	140,000	1,134,000.00	0.61
----	--------	------	---------	--------------	------

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	12,252,693.70	6.64
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	12,252,693.70	6.64

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	019664	21国债16	120,000	12,252,693.70	6.64

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	401,482.50
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,050.51
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	402,533.01

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	007127	博道远航混合C	契约型开放式	9,329,477.24	11,824,179.45	6.41	否
2	450001	国富中国收益混合	契约型开放式	9,347,608.53	11,623,751.21	6.30	否
3	010386	华安汇嘉精选混合C	契约型开放式	9,000,000.00	8,720,100.00	4.72	否
4	009804	国泰研究优势混合	契约型开放式	7,350,579.95	8,449,491.65	4.58	否
5	002943	广发多因子混合	契约型开放式	2,743,879.41	8,131,761.02	4.41	否
6	001736	圆信永丰优加生活	契约型开放式	2,669,949.64	7,780,233.25	4.22	否
7	165525	基建工程LOF	契约型开放式	9,069,714.00	6,334,288.26	3.43	否
8	009058	博时科技创新混合C	契约型开放式	4,182,128.07	6,165,711.41	3.34	否
9	501075	科创主题	契约型开放式	2,699,900.00	5,099,301.13	2.76	否
10	501054	东证睿泽	契约型开放式	4,420,956.00	4,876,314.47	2.64	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用2022年07月01日至 2022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）	35,785.27	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	190,953.22	1,023.40
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	70,408.40	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	575,419.49	23,194.49

当期持有基金产生的应支付托管费（元）	98,431.94	3,537.55
当期交易基金产生的交易费（元）	12,254.69	-
当期交易基金产生的转换费（元）	103,073.83	-

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）、销售服务费等销售费用。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	172,669,867.62	95,942,518.47
报告期期间基金总申购份额	524,280.96	145,051.35
减：报告期期间基金总赎回份额	17,778,621.15	14,126,018.97
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	155,415,527.43	81,961,550.85

§ 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

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、《中信建投睿选6个月持有期混合型证券投资基金（FOF）基金合同》；
- 3、《中信建投睿选6个月持有期混合型证券投资基金（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

2022年10月26日