

建信智汇优选一年持有期混合型管理人中  
管理人（MOM）证券投资基金  
2025 年第 2 季度报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 7 月 18 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 7 月 16 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 建信智汇优选一年持有期混合（MOM）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 基金主代码      | 011189                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 基金合同生效日    | 2021 年 1 月 26 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 报告期末基金份额总额 | 1,486,043,879.16 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 投资目标       | 本基金通过优选投资顾问为特定资产单元提供投资建议和灵活的投资策略，捕捉市场中的投资机会，并且采用有效的风险管理措施，降低波动风险的同时，争取获取稳定的收益。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 投资策略       | <p>本基金为混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金，将通过优选投资顾问为特定资产单元提供投资建议。本基金的投资策略主要分为四个层次：大类资产配置策略、子资产单元划分策略、投资顾问选择策略和个券投资策略。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>1、战略性资产配置</p> <p>本产品为风险收益特征相对平衡的基金。为了保持平衡的风险收益特征，本基金的长期资产配置比例为权益类资产和固定收益类资产 6:4，并引入不同市场的权益资产增加组合的分散程度。本基金的战略资产配置方案为：A 股权益类资产的投资占比为 50%，港股权益类资产的投资占比为 10%，固定收益类资产的投资占比为 40%。</p> <p>2、战术性组合调整</p> <p>为进一步增强组合收益并控制最大回撤，本基金根据对市场的判断对战略资产配置方案进行调整，可以将权益类资产占比最低调整到 30%，最高调整至 75%。</p> <p>（二）子资产单元划分策略</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>本基金分为价值、成长和固定收益三个子资产单元，三个子资产单元间相关性较低，能够有效分散风险。本基金对价值和成长单元进行均衡配置，能够充分利用两者超额收益负相关所带来的分散化效果，达到熨平波动，稳健增值的目的。</p> <p>（三）投资顾问选择策略</p> <p>本基金选择具备长期稳定业绩、良好风险控制能力以及综合实力强的公募基金管理人作为投资顾问。</p> <p>1、投资顾问的选聘</p> <p>（1）投资顾问应为公募基金管理人，具有丰富的投资管理经验，具有良好的合规和诚信记录，以及具有充分的风险识别和承受能力。</p> <p>（2）基金管理人遵循定量分析与定性尽职调查相结合的原则对符合标准的投资顾问及其拟聘任投资经理做进一步筛选。其中定量分析包括对投资顾问的产品、规模、业绩等方面的指标进行量化评价和初选。对投资顾问拟聘任的投资经理所管理产品的绩效指标（收益、夏普率、信息比率等）、风险控制指标（最大回撤、波动率等）、行业和风格偏好等指标进行量化评价和初选。</p> <p>2、投资顾问的监督、考核与评估</p> <p>根据与投资顾问签署的投顾协议的约定，基金管理人会对投资顾问及投资经理每年度进行业绩考核，对连续两次考核均不达资产单元业绩比较基准的，建信基金需重新评估投资经理的适合性，根据需要要求投资顾问变更投资经理。</p> <p>3、投资顾问的解聘</p> <p>对于投资顾问聘用的投资经理，连续两次考核均不达资产单元业绩比较基准的，基金管理人需重新评估投资经理的适合性，根据需要要求投资顾问变更投资经理，并对投资顾问拟聘用的新的投资经理进行尽职调查、综合评价，出具研究报告，由投资决策委员会进行评审。如投资顾问拒绝或未能在基金管理人要求的时间内更换投资经理，基金管理人需根据投顾协议的约定解聘其做为投资顾问。</p> <p>（四）个券投资策略</p> |
| 业绩比较基准 | $50\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 10\% \times \text{恒生指数收益率} + 40\% \times \text{中债综合财富指数收益率}$                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型管理人中管理人基金，高于债券型基金、债券型管理人中管理人基金及货币市场基金及货币型管理人中管理人基金。本基金的基金资产如投资于港股，会面临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。基金管理人将参考各投资顾问的建议进行投资操作，因此投资顾问的投资管理水平和各资产单元的业绩表现将影响基金的业绩表现。基金管理人虽然对投资顾问进行了严格的尽职调查，但不能保证投资顾问的投资建议一定准确有效。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 基金管理人  | 建信基金管理有限责任公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 基金托管人  | 交通银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 基金投资顾问 | 广发基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|        | 景顺长城基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

§ 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 4 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | -47,783,298.08                        |
| 2. 本期利润         | -307,336.50                           |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0002                               |
| 4. 期末基金资产净值     | 1,102,083,304.34                      |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.7416                                |

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。

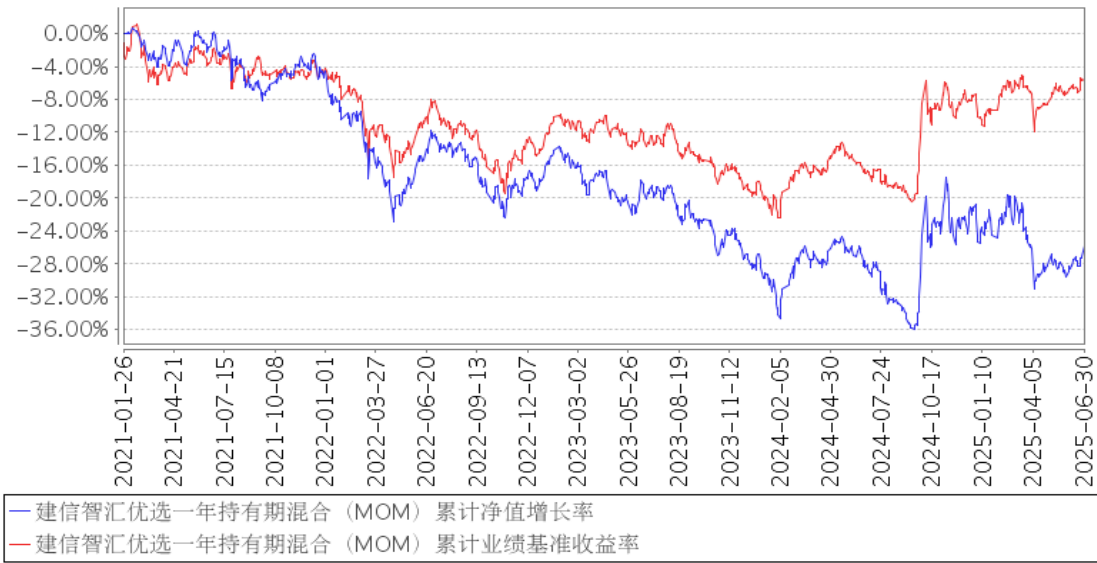
3.2 基金净值表现

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

| 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          | 0.14%      | 1.08%         | 1.73%          | 0.76%                 | -1.59%  | 0.32% |
| 过去六个月          | -4.52%     | 1.21%         | 2.85%          | 0.69%                 | -7.37%  | 0.52% |
| 过去一年           | 3.43%      | 1.37%         | 13.64%         | 0.82%                 | -10.21% | 0.55% |
| 过去三年           | -15.64%    | 0.99%         | 3.04%          | 0.67%                 | -18.68% | 0.32% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -25.84%    | 0.92%         | -5.59%         | 0.68%                 | -20.25% | 0.24% |

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

建信智汇优选一年持有期混合（MOM）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



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.3 其他指标

无。

§ 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 姚波远 | 本基金的基金经理 | 2024 年 1 月 12 日 | —    | 9      | 姚波远先生，博士。曾任工银瑞信基金管理有限公司助理定量分析师、祈安资本管理有限公司研究员、建信资本管理有限责任公司投资经理助理等职务。2022 年 12 月加入建信基金，现任数量投资部基金经理。2023 年 8 月 31 日起任建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）的基金经理；2024 年 1 月 12 日起任建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金的基金经理；2024 年 1 月 12 日起任建信优享进取养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。 |

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金基金合同》的规定。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与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的 5% 的情况有 3 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2025 年 2 季度，权益市场大致呈先抑后扬走势，波动主要来自于关税冲击及后续谈判进展。固收市场方面，债市利率 4 月快速下行后总体低位震荡。

权益方面，2 季度主要宽基指数取得正收益。4 月初特朗普宣布全面关税政策超出预期，随后中国进行反制，市场担忧关税冲突升级，风险偏好大幅回落，受此冲击市场出现快速调整；此后美国宣布暂缓对等关税 90 天，中美双方对部分重要产业进行了关税豁免；5 月初中美日内瓦谈判取得进展，6 月初中美元首通话后，两国在伦敦进行经贸磋商，贸易摩擦进一步缓和。期间，中国及美国的经济基本面总体上保持韧性，关税对于实体经济的冲击不显著。市场在震荡中修复，2 季度末上证指数创年内新高。2 季度，上证指数、沪深 300、创业板指数分别上涨 3.26%、1.25% 和 2.34%，偏股基金指数上涨 3.06%；风格方面，小盘股表现好于大盘，中证 2000 上涨 7.62%。结构分化明显，市场更看重确定性和行业基本面；内需板块中的食品饮料跌幅超过 6%，家电、汽车、建材和地产也表现较差；表现最好的行业为受事件驱动的军工，上涨超过 15%，银行和通信涨幅

也超过 10%。

固收方面，在关税冲击及双降落地的影响下，利率 4 月快速下行，之后总体低位震荡，1 年期及 10 年期国债到期收益率分别自上季度末的 1.50%、1.82%下行至 1.35%、1.65%附近。2 季度以来央行对资金面的呵护增强，5 月降准落地释放长期流动性，资金价格跟随政策利率中枢下台阶，季度来看流动性整体偏宽松，资金利率整体处于下行趋势。信用方面，4 月信用债大致跟随利率走势波动，5 月以来信用利差快速收窄，信用债表现总体好于利率债。

回顾报告期内的运作，管理人通过量化资产配置模型对组合整体的风格敞口与行业敞口进行了监测管理。纵观 2025 年 2 季度，组合整体维持较为积极的权益仓位，增加价值红利类个股持仓，结构上向均衡配置进行回归。债券部分以持有短久期高等级信用债为主，获取票息收益，为组合提供稳健安全垫收益。

从投资顾问景顺长城来看，在政策维稳的环境下，国内宏观经济保持稳定，下行风险不大。企业经营处于触底阶段，反内卷将逐步改善供需状况，有利于优质公司的经营改善。外需方面，关税战从针锋相对到接触谈判，说明全球产业已深度交融，各个经济体的相对优势仍非常明显，数年内都很难形成替代，相互依存关系将持续较长时间。中国在制造业规模化生产能力仍然傲居世界之首，产业集群及配套能力雄关全球，产业连迭代环境优越，工程师红利持续护航，优势产业链中的国际地位稳固、优势明显、且估值性价比高的优质公司具有较高的长期投资价值。从产业趋势看，关注创新药的投资机会。受集采政策影响，创新药基本面基本出清，临床技术的提升，低成本、高迭代的临床环境，管线研发成果逐步显现，看好行业研发成果逐步落地兑现业绩的投资机会。

从投资顾问广发基金来看，展望 2025 年 3 季度，我们更关注国内宏观经济的表现，以及海外关税政策的变化结果。从国内经济基本面看，4 月至 6 月 PMI 指数低位运行。内需消费在政策托底下有所企稳，汽车、家电、两轮车等行业受益“以旧换新”政策而需求有所增长；地产销售方面，二手房好于新房，核心城市有企稳迹象。出口方面，美国关税冲击有所缓解，下半年预计美国“美丽大法案”通过概率较大，叠加降息预期，出口景气度有可能持续。部分制造业产能过剩问题仍需等待供给侧改革和市场化出清。价格指数方面，国内 PPI 和 CPI 仍处于较低水平，关注后续改善情况。货币与财政政策方面，国内货币政策和财政政策仍有空间，宽松的流动性有利于稳住整体资本市场。A 股总体估值处于偏低水平，长期看符合均值回归的趋势，整体保持适当积极乐观。

我们将继续秉持稳中求进的原则，充分发挥 MOM 产品多元化、分散化的特点与优势，与投资顾问深度合作，通过宏观掌控战略配置、中观调节战术策略、微观关注底层资产的精细化管理模

式，紧密跟踪市场变化，跟踪企业盈利，把握政策导向，发掘投资线索，以勤勉审慎的态度管理好投资组合。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 0.14%，波动率 1.08%，业绩比较基准收益率 1.73%，波动率 0.76%。

#### 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              | 802,578,262.71   | 72.37        |
|    | 其中：股票             | 802,578,262.71   | 72.37        |
| 2  | 基金投资              | —                | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 198,914,008.88   | 17.94        |
|    | 其中：债券             | 198,914,008.88   | 17.94        |
|    | 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      | 105,295,341.55   | 9.49         |
| 8  | 其他资产              | 2,240,266.89     | 0.20         |
| 9  | 合计                | 1,109,027,880.03 | 100.00       |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 180,711,370.11 元，占期末基金资产净值比例为 16.40%。

#### 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              | 120,775,149.20 | 10.96        |
| C  | 制造业              | 310,943,067.95 | 28.21        |
| 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     | —              | —     |
| H | 住宿和餐饮业          | —              | —     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 135,428,115.45 | 12.29 |
| J | 金融业             | 2,871,875.00   | 0.26  |
| K | 房地产业            | —              | —     |
| L | 租赁和商务服务业        | 2,517,040.00   | 0.23  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 9,730,045.00   | 0.88  |
| 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       | 39,601,600.00  | 3.59  |
| S | 综合              | —              | —     |
|   | 合计              | 621,866,892.60 | 56.43 |

### 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（%） |
|---------------------------------|----------------|--------------|
| Materials 材料                    | 2,026,808.88   | 0.18         |
| Consumer Staples 日常生活消费品        | 1,597,189.23   | 0.14         |
| Consumer Discretionary 非日常消费品   | 47,284,211.71  | 4.29         |
| Energy 能源                       | 939,673.28     | 0.09         |
| Financials 金融                   | 1,524,780.40   | 0.14         |
| Health Care 医疗保健                | —              | —            |
| Industrials 工业                  | 1,129,010.03   | 0.10         |
| Real Estate 房地产                 | 3,093,480.58   | 0.28         |
| Information Technology 信息技术     | 80,856,149.90  | 7.34         |
| Telecommunication Services 通讯服务 | 40,828,017.92  | 3.70         |
| Utilities 公用事业                  | 1,432,048.18   | 0.13         |
| 合计                              | 180,711,370.11 | 16.40        |

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 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  | 002517 | 恺英网络 | 2,378,900 | 45,936,559.00 | 4.17         |
| 2  | 00700  | 腾讯控股 | 89,006    | 40,828,017.92 | 3.70         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 3  | 600489 | 中金黄金 | 2,748,172 | 40,205,756.36 | 3.65 |
| 4  | 600547 | 山东黄金 | 1,249,788 | 39,905,730.84 | 3.62 |
| 5  | 300364 | 中文在线 | 1,494,400 | 39,601,600.00 | 3.59 |
| 6  | 002475 | 立讯精密 | 1,118,800 | 38,811,172.00 | 3.52 |
| 7  | 002155 | 湖南黄金 | 2,153,320 | 38,436,762.00 | 3.49 |
| 8  | 600183 | 生益科技 | 1,141,412 | 34,413,571.80 | 3.12 |
| 9  | 002558 | 巨人网络 | 1,373,489 | 32,345,665.95 | 2.93 |
| 10 | 00981  | 中芯国际 | 777,500   | 31,694,138.29 | 2.88 |

#### 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      | 3,154,070.14   | 0.29         |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | 72,718,323.29  | 6.60         |
|    | 其中：政策性金融债 | 42,076,323.29  | 3.82         |
| 4  | 企业债券      | —              | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | 42,079,743.67  | 3.82         |
| 6  | 中期票据      | 80,961,871.78  | 7.35         |
| 7  | 可转债（可交换债） | —              | —            |
| 8  | 同业存单      | —              | —            |
| 9  | 其他        | —              | —            |
| 10 | 合计        | 198,914,008.88 | 18.05        |

#### 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  | 102580743 | 25 汇金 MTN001   | 500,000 | 50,271,654.79 | 4.56         |
| 2  | 241778    | 24 国证 G1       | 300,000 | 30,642,000.00 | 2.78         |
| 3  | 190210    | 19 国开 10       | 200,000 | 21,576,000.00 | 1.96         |
| 4  | 102484909 | 24 云投 MTN018   | 200,000 | 20,562,085.48 | 1.87         |
| 5  | 012581190 | 25 远东租赁 SCP004 | 120,000 | 12,028,120.11 | 1.09         |

#### 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。

#### 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。

#### 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。

## 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 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 5.10.2 本期国债期货投资评价

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是否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

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 947,846.15   |
| 2  | 应收证券清算款 | —            |
| 3  | 应收股利    | 1,290,092.84 |
| 4  | 应收利息    | —            |
| 5  | 应收申购款   | 2,327.90     |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 其他      | —            |
| 8  | 合计      | 2,240,266.89 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 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。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## §6 管理人中管理人（MOM）产品

### 6.1 报告期末各资产单元的资产净值及占基金资产净值的比例

| 资产单元 | 投资顾问名称       | 报告期末资产单元资产净值（元） | 占期末基金资产净值比例（%） |
|------|--------------|-----------------|----------------|
| 1    | 广发基金管理有限公司   | 117,172,200.22  | 10.63          |
| 2    | 景顺长城基金管理有限公司 | 98,291,594.97   | 8.92           |

### 6.2 基金投资顾问

| 序号 | 投资顾问名称       | 是否与基金管理人存在关联关系 | 是否与其他投资顾问存在关联关系 |
|----|--------------|----------------|-----------------|
| 1  | 广发基金管理有限公司   | 否              | 否               |
| 2  | 景顺长城基金管理有限公司 | 否              | 否               |

## §7 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,559,482,908.46 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,621,237.73     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 75,060,267.03    |
| 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               | 1,486,043,879.16 |

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

## §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

无。

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 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

无。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金设立的文件；

2、《建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金基金合同》；

3、《建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金招募说明书》；

4、《建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金托管协议》；

5、基金管理人业务资格批件和营业执照；

6、基金托管人业务资格批件和营业执照；

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2025 年 7 月 18 日