
中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金

2023年第3季度报告

2023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:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2023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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023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2023年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 中信建投北交所精选两年定开混合 |
| 基金主代码 | 016303 |
| 基金运作方式 | 契约型、定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022年08月16日 |
| 报告期末基金份额总额 | 267,006,443.63份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于在北京证券交易所上市的企业，在严格控制投资组合风险和保持资产流动性的前提下，灵活运用多种投资策略，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 | 本基金将采用“自上而下”的资产配置策略，在综合判断宏观经济基本面、流动性水平等宏观因素的基础上，通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在个券投资方面采用“自下而上”精选策略，通过严谨个股选择、信用分析以及对券种收益水平、流动性的客观判断，综合运用多种投资策略，精选个券构建投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 中证1000指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债综合指数收益率×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。 |

| | | |
|------------------|--|------------------|
| | <p>本基金主要投资于北京证券交易所上市的证券，除了需要承担与证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临投资北京证券交易所上市证券的特殊风险。</p> <p>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。</p> | |
| 基金管理人 | 中信建投基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 下属各类别基金的基金简称 | 中信建投北交所精选两年定开混合A | 中信建投北交所精选两年定开混合C |
| 下属各类别基金的交易代码 | 016303 | 016304 |
| 报告期末下属各类别基金的份额总额 | 220,509,584.69份 | 46,496,858.94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(2023年07月01日 - 2023年09月30日) | |
|----------------|--------------------------------|------------------|
| | 中信建投北交所精选两年定开混合A | 中信建投北交所精选两年定开混合C |
| 1.本期已实现收益 | -90,210.20 | -63,227.58 |
| 2.本期利润 | -14,895,772.83 | -3,173,069.41 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0676 | -0.0682 |
| 4.期末基金资产净值 | 203,193,201.30 | 42,653,388.06 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9215 | 0.9173 |

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

中信建投北交所精选两年定开混合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 | -6.83% | 0.90% | -6.38% | 0.76% | -0.45% | 0.14% |
| 过去六个月 | -8.92% | 0.82% | -8.99% | 0.74% | 0.07% | 0.08% |
| 过去一年 | -7.63% | 0.76% | 0.26% | 0.78% | -7.89% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -7.85% | 0.71% | -12.03% | 0.82% | 4.18% | -0.11% |

中信建投北交所精选两年定开混合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 | -6.93% | 0.90% | -6.38% | 0.76% | -0.55% | 0.14% |
| 过去六个月 | -9.10% | 0.82% | -8.99% | 0.74% | -0.11% | 0.08% |
| 过去一年 | -8.00% | 0.76% | 0.26% | 0.78% | -8.26% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -8.27% | 0.71% | -12.03% | 0.82% | 3.76% | -0.11% |

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

中信建投北交所精选两年定开混合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
(2022年08月16日-2023年09月30日)



中信建投北交所精选两年定开混合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
(2022年08月16日-2023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 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-----|-------------------|------------|---|-----|--|
| 周紫光 | 本基金的基金经理、研究部行政负责人 | 2022-08-16 | - | 13年 | 中国籍，1983年7月生，大连理工大学工学硕士。曾任江海证券有限责任公司研究员、平安证券股份有限公司研究员、方正证券股份有限公司研究员。2016年3月加入中信建投基金管理有限责任公司，曾任投资研究部研究员，现任本公司研究部行政负责人、基金经理，担任中信建投智信物联网灵活配置混合型证券投资基金、中信建投智享生活混合型证券投资基金、中信建投低碳成长混合型证券投资基金、中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金、中信建投科技主题6个月持有期混合型证券投资基金基金经理。 |
| 孙文 | 本基金的基金经理 | 2022-08-16 | - | 7年 | 中国籍，1990年10月生，对外经济贸易大学金融学硕士。2016年7月加入中信建投基金管理有限责任公司，曾任交易部股票交易员、研究部研究员、权益投资部基金经理助理，现任本公司权益投资一部基金经理，担任中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金、中信建投消费升级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

2023年第三季度，由于对国内宏观经济越发悲观，以及人民币持续贬值的背景下，A股持续走差，市场维持了主题炒作的行情，主题轮动加速，但呈现了下跌态势。北交所由于其目前仍处于流动性较差的阶段，板块行情非常容易受到其它主板的影响，甚至是加剧表现，单三季度，北证50下跌8.7%，在各类指数中排后靠后，本产品持仓股票全部为北交所股票，由于某些持仓公司的业务进展低于预期，导致三季度净值下跌幅度也仅略好于北证50指数。

展望四季度，我们认为在国内政策频频出台、中美关系阶段缓和、美国加息尾声、国内经济数据可能逐渐走暖的背景下，资本市场的信心也有望修复。新的主题方向还会有机会，之前超跌的基本面方向也可能得以修复。如果其它主板情绪转暖，流动性转好，则北交所板块也将随之受益。

未来，我们仍将基于长期和价值研究体系，继续深耕北交所，侧重绝对收益思路，优选股票构建组合，希望获得较好的结果。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投北交所精选两年定开混合A基金份额净值为0.9215元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.83%，同期业绩比较基准收益率为-6.38%；截至报告期末中信建投北交所精选两年定开混合C基金份额净值为0.9173元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.93%，同期业绩比较基准收益率为-6.38%。

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 | 172,158,677.90 | 69.90 |
| | 其中：股票 | 172,158,677.90 | 69.90 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 72,814,985.77 | 29.57 |
| 8 | 其他资产 | 1,310,727.51 | 0.53 |
| 9 | 合计 | 246,284,391.18 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 155,476,165.80 | 63.24 |
| 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 | 3,636,600.00 | 1.48 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 11,743,912.10 | 4.78 |
| 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 | 1,302,000.00 | 0.53 |
| 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 | 172,158,677.90 | 70.03 |

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 | 834033 | 康普化学 | 653,783 | 23,817,314.69 | 9.69 |
| 2 | 831152 | 昆工科技 | 1,050,088 | 18,901,584.00 | 7.69 |
| 3 | 838402 | 硅烷科技 | 1,619,632 | 18,172,271.04 | 7.39 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 4 | 836077 | 吉林碳谷 | 750,000 | 12,420,000.00 | 5.05 |
| 5 | 839371 | 欧福蛋业 | 2,943,300 | 9,977,787.00 | 4.06 |
| 6 | 830946 | 森萱医药 | 1,290,000 | 8,707,500.00 | 3.54 |
| 7 | 430425 | 乐创技术 | 700,523 | 8,490,338.76 | 3.45 |
| 8 | 430139 | 华岭股份 | 745,289 | 8,049,121.20 | 3.27 |
| 9 | 831195 | 三祥科技 | 800,000 | 6,976,000.00 | 2.84 |
| 10 | 835179 | 凯德石英 | 300,041 | 5,703,779.41 | 2.32 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

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

无余额。

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 | 15,982.19 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,294,745.32 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,310,727.51 |

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

| | 中信建投北交所精选两年定开混合A | 中信建投北交所精选两年定开混合C |
|-------------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 220,509,584.69 | 46,496,858.94 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - | - |
| 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 | 220,509,584.69 | 46,496,858.94 |

§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

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2023年8月26日披露《中信建投基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》《中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》《中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金托管协议》。

§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、《中信建投北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投北交所精选两年定期开放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。

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

2023年10月25日