

中信建投睿选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）  
2026 年第 2 季度报告

2026 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:2026 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2026年07月20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2026年04月01日起至2026年06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                                                                                                                                                                                                                                        |
| 基金合同生效日    | 2021 年 11 月 02 日                                                                                                                                                                                                                              |
| 报告期末基金份额总额 | 50,286,188.87 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。<br>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     | 中证偏股型基金指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%                                                                                                                                                                                                             |
| 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                                             |                       |
| 下属分级基金的基金简称     | 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 |
| 下属分级基金的交易代码     | 013844                                                 | 013845                |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 33,773,942.11 份                                        | 16,512,246.76 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（2026 年 04 月 01 日-2026 年 06 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      | -1,155,853.30                          | -577,857.08           |
| 2. 本期利润         | -1,009,550.57                          | -484,637.35           |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0276                                | -0.0272               |
| 4. 期末基金资产净值     | 35,697,565.62                          | 17,174,405.95         |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0570                                 | 1.0401                |

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

中信建投睿选 6 个月持有混合（FOF）A 净值表现

| 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          | -3.27%     | 1.07%         | 21.60%         | 1.33%                 | -24.87% | -0.26% |
| 过去六个月          | 11.24%     | 1.41%         | 19.91%         | 1.23%                 | -8.67%  | 0.18%  |
| 过去一年           | 39.87%     | 1.21%         | 45.34%         | 1.11%                 | -5.47%  | 0.10%  |
| 过去三年           | 36.16%     | 1.00%         | 60.15%         | 1.03%                 | -23.99% | -0.03% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 5.70%      | 0.99%         | 38.51%         | 0.95%                 | -32.81% | 0.04%  |

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<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          | -3.34%     | 1.07%         | 21.60%         | 1.33%                 | -24.94% | -0.26% |
| 过去六个月          | 11.23%     | 1.41%         | 19.91%         | 1.23%                 | -8.68%  | 0.18%  |
| 过去一年           | 39.54%     | 1.21%         | 45.34%         | 1.11%                 | -5.80%  | 0.10%  |
| 过去三年           | 34.90%     | 1.00%         | 60.15%         | 1.03%                 | -25.25% | -0.03% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 4.01%      | 0.99%         | 38.51%         | 0.95%                 | -34.50% | 0.04%  |

注：根据基金管理人于 2024 年 9 月 30 日披露的《关于中信建投睿选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）变更业绩比较基准并修订基金合同及托管协议的公告》《中信建投睿选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》，自 2024 年 9 月 30 日起，本基金的业绩比较基准由“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）”变更为“中证偏股型基金指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%”。

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





注：根据基金管理人于 2024 年 9 月 30 日披露的《关于中信建投睿选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）变更业绩比较基准并修订基金合同及托管协议的公告》《中信建投睿选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》，自 2024 年 9 月 30 日起，本基金的业绩比较基准由“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）”变更为“中证偏股型基金指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%”。

## § 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 |                            |                                                                                                                                               |
| 刘宁 | 本基金的基金经理 | 2021-11-02      | —    | 11<br>年                    | 中国籍，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、FOF 投资部基金经理，现任本公司 |

|  |  |  |  |  |                                                |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 多元资产配置部基金经理，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，本基金运作整体合法合规。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》、其他有关法律法规及基金合同的约定，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，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

第二季度，沪深 300 指数上涨 11.9%，创业板指数上涨 36.35%，恒生指数下跌 7.69%，标普 500 指数上涨 14.87%。万得偏股混合型基金指数同期上涨 19.26%。本季度的市场聚焦 AI，以下为本季度的主要操作与市场观点：

第一，美联储新主席发布会鹰派表态后，黄金又遭遇第三轮抛售，主因在于全球 ETF 投资者将资金转向股票市场（主要是半导体）。在此期间，我们仍坚持按多资产框架进行标准配置，未因短期大跌而放弃该大类资产，并利用大宗商品波动进行了一定的优化与增强。黄金从顶部至今回撤达 30%，美元和利率上升逻辑上利空黄金，但是否下半年加息不确定。如果加息，那么所有风险资产都将面临利空；如果不加息保持现状，看实际利率的变动趋势，金融属性强的黄金和工业属性强的铜铝走势将分化；石油等其他通胀密切相关的大宗商品将用于组合对冲利率波动风险。

第二，AI 产业的发展焦点已从早期的 GPU 紧缺，逐步延伸至材料散热、存储产能、电力保障、光纤光缆等配套环节，本季度半导体设备和材料表现良好。但由于该领域估值持续走高，已远超本

基金设定的估值上限，因此我们相对市场低配了 AI 相关资产，这在一定程度上影响了第二季度的相对收益表现。市场因 AI 主题 ETF 及科创创业等宽基指数持续对其他板块形成资金虹吸，出现明显的“K 型”分化，如果将沪深 300 指数 AI 相关股票剔除，指数其他股票的回撤幅度堪比 2022 年熊市。考虑到本基金对组合估值的偏低要求，在价值类资产池中进行基金精选、个股选择及波段操作的能力面临更大考验。

第三，有色股与大宗商品联动性较高。本季度我们对有色基金维持超配，同时通过跨资产多品种的对冲配置，有效控制高波动对组合的负面影响。当前战略小金属股（算力金属概念）估值高，但大宗工业金属股估值低，板块内的分化逻辑和宽基指数中的“K 型”分化是类似的，而且也在其他板块中出现此现象。

第四，二季度整体压缩利率敞口相关资产，对金融类板块整体低配。

第五，海外流动性相较于去年四季度未见显著改善，同时港股相较于 A 股的性价比有所下降。港股市场估值持续压缩，主要受蓝筹公司业绩预期下修及资金持续流出影响，我们维持低配港股资产的策略。

第六，在大消费领域，二季度保持医药类基金的配置，该领域投资逻辑相对独立于其他板块。

本基金于 6 月下旬披露了变更业绩比较基准的相关公告，并将于 7 月 27 日正式生效，本次将业绩比较基准变更为多资产基准，权益部分沿用中证偏股基金指数，增加标普 500 作为海外资产代表，黄金权重作为大宗商品类资产的代理指标，并根据过去三年基金在各类资产中的平均配置比例，设置了相应权重，力求更贴近本基金的实际运作情况。2024 年 9 月，彼时业绩比较基准新规尚未出台，权益部分先行进行基准变更，本次则将其他资产补充纳入基准体系。

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，通过提高基金配置的精准度，改善投资效果。本基金采用大类资产配置、宏观对冲、风险平价与主观量化相结合的方式，尽力发挥 FOF 投资的优势。

在此，感谢各位持有人的耐心与支持！

#### 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 1.0570 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.27%，同期业绩比较基准收益率为 21.60%；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 1.0401 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.34%，同期业绩比较基准收益率为 21.60%。

#### 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              | 1,359,396.00  | 2.55         |
|    | 其中：股票             | 1,359,396.00  | 2.55         |
| 2  | 基金投资              | 44,632,811.08 | 83.75        |
| 3  | 固定收益投资            | 4,050,501.92  | 7.60         |
|    | 其中：债券             | 4,050,501.92  | 7.60         |
|    | 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      | 3,244,544.29  | 6.09         |
| 8  | 其他资产              | 5,854.80      | 0.01         |
| 9  | 合计                | 53,293,108.09 | 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              | 403,440.00   | 0.76         |
| 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      | 955,956.00   | 1.81         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -            | -            |
| 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       | -            | -            |
| 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               | 1,359,396.00 | 2.57         |



## 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。

## 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  | 001872 | 招商港口 | 49,200 | 955,956.00 | 1.81         |
| 2  | 600482 | 中国动力 | 12,300 | 403,440.00 | 0.76         |

## 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      | 4,050,501.92 | 7.66         |
| 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        | 4,050,501.92 | 7.66         |

## 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  | 019785 | 25 国债 13 | 40,000 | 4,050,501.92 | 7.66         |

## 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 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 5.9.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 5.10.3 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

本基金投资的前十名证券/基金的发行主体中，嘉实基金管理有限公司在报告编制日前一年内曾被中国证券监督管理委员会北京监管局采取责令改正并暂停受理固定收益类公募基金产品注册申请 3 个月的行政监管措施，华夏基金管理有限公司在报告编制日前一年内曾被中国证券监督管理委员会北京监管局采取出具警示函的行政监管措施，华安基金管理有限公司在报告编制日前一年内曾被中国证券监督管理委员会上海监管局采取责令改正并暂停受理固定收益类公募基金产品注册申请 3 个月的行政监管措施，国泰基金管理有限公司在报告编制日前一年内曾被中国证券监督管理委员会上海监管局采取责令改正的行政监管措施。

本基金对上述主体所发行证券/基金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/基金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约定的备选股票库情况的说明

本报告期内，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

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 | -        |
| 3  | 应收股利    | 101.25   |
| 4  | 应收利息    | -        |
| 5  | 应收申购款   | 5,753.55 |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 其他      | -        |
| 8  | 合计      | 5,854.80 |

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  | 159502 | 嘉实标普生物科技精选行业ETF(QDII) | 交易型开放式 | 3,119,300.00 | 5,100,055.50 | 9.65         | 否                      |
| 2  | 000754 | 华宝量化对冲混合              | 契约型开放式 | 4,027,492.18 | 4,629,199.51 | 8.76         | 否                      |

|    |        |                             |            |              |              |      |   |
|----|--------|-----------------------------|------------|--------------|--------------|------|---|
|    |        | C                           |            |              |              |      |   |
| 3  | 159326 | 华夏中证<br>电网设备<br>主题 ETF      | 交易型<br>开放式 | 2,200,000.00 | 4,593,600.00 | 8.69 | 否 |
| 4  | 159980 | 大成有色<br>金属期货<br>ETF         | 交易型<br>开放式 | 2,184,300.00 | 4,490,920.80 | 8.49 | 否 |
| 5  | 010386 | 华安汇嘉<br>精选混合<br>C           | 契约型<br>开放式 | 2,734,910.50 | 4,380,506.15 | 8.29 | 否 |
| 6  | 518880 | 华安黄金<br>ETF                 | 交易型<br>开放式 | 500,000.00   | 4,189,000.00 | 7.92 | 否 |
| 7  | 518800 | 国泰黄金<br>ETF                 | 交易型<br>开放式 | 473,700.00   | 4,159,086.00 | 7.87 | 否 |
| 8  | 560860 | 万家中证<br>工业有色<br>金属主题<br>ETF | 交易型<br>开放式 | 2,524,300.00 | 4,089,366.00 | 7.73 | 否 |
| 9  | 001870 | 前海开源<br>货币 A                | 契约型<br>开放式 | 3,491,532.12 | 3,491,532.12 | 6.60 | 否 |
| 10 | 516150 | 嘉实中证<br>稀土产业<br>ETF         | 交易型<br>开放式 | 1,674,900.00 | 3,433,545.00 | 6.49 | 否 |

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目                       | 本期费用<br>2026年04月01日至2026年06<br>月30日 | 其中：交易及持有基金管理人以<br>及管理人关联方所管理基金产生<br>的费用 |
|--------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费<br>(元)      | -                                   | -                                       |
| 当期交易基金产生的赎回费<br>(元)      | 7,782.38                            | -                                       |
| 当期持有基金产生的应支付<br>销售服务费(元) | 9,328.86                            | -                                       |
| 当期持有基金产生的应支付<br>管理费(元)   | 90,578.83                           | -                                       |
| 当期持有基金产生的应支付<br>托管费(元)   | 16,403.98                           | -                                       |
| 当期交易基金产生的交易费<br>(元)      | 43,386.19                           | -                                       |
| 当期交易基金产生的转换费<br>(元)      | 23,306.83                           | -                                       |

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（按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务等销售费用。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               | 39,833,075.84         | 19,573,344.05         |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,422,770.38          | 961,282.13            |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 7,481,904.11          | 4,022,379.42          |
| 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               | 33,773,942.11         | 16,512,246.76         |

## § 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 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《中信建投睿选 6 个月持有期混合型基金中基金（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；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 10.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所。

### 10.3 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

二〇二六年七月二十一日