中信建投稳利混合型证券投资基金
2026年中期报告

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08月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 1
1.1 重要提示 1
1.2 目录 2
§2 基金简介 4
2.1 基金基本情况 4
2.2 基金产品说明 4
2.3 基金管理人和基金托管人 4
2.4 信息披露方式 5
2.5 其他相关资料 5
§3 主要财务指标和基金净值表现 5
3.1 主要会计数据和财务指标 5
3.2 基金净值表现 6
§4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 11
§5 托管人报告 11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12
§6 半年度财务会计报告(未经审计) 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 13
6.3 净资产变动表 14
6.4 报表附注 16
§7 投资组合报告 39
7.1 期末基金资产组合情况 39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 45
7.6 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 45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 46
7.8 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贵金属投资明细 46
7.9 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 46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 46
7.12 投资组合报告附注 46

§8 基金份额持有人信息 48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 48
8.2 盈利投资者数量占比 48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 49
§9 开放式基金份额变动 49
§10 重大事件揭示 49
10.1 基金份额持有人大会决议 49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 49
10.4 基金投资策略的改变 50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 50
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 50
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 50
10.8 其他重大事件 51
§11 影响投资者决策的其他重要信息 52
11.1 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 52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 52
§12 备查文件目录 52
12.1 备查文件目录 52
12.2 存放地点 53
12.3 查阅方式 53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投稳利混合型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	117,289,805.27 份	
基金合同存续期	不定期	
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	32,918,318.52 份	84,371,486.75 份

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信建投基金管理有限公司	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟	闫朝
	联系电话	010-56950806	010-66223587
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	yanzhao@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95526
传真		010-65289868	010-89661115

注册地址	北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室	北京市西城区金融大街甲 17 号首层
办公地址	北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层	北京市西城区金融大街丙 17 号
邮政编码	100010	100033
法定代表人	金强	关文杰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	中信建投稳利 A	中信建投稳利 C
本期已实现收益	2,332,328.59	611,166.45
本期利润	474,206.97	-1,736,795.19
加权平均基金份额本期利润	0.0162	-0.0974
本期加权平均净值利润率	1.07%	-6.99%
本期基金份额净值增长率	2.05%	1.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	16,429,958.20	30,993,531.62
期末可供分配基金份额利润	0.4991	0.3673
期末基金资产净值	49,019,223.73	115,365,018.37
期末基金份额净值	1.4891	1.3673
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	44.06%	36.73%

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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、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 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.03%	0.55%	3.30%	0.26%	-3.27%	0.29%
过去六个月	2.05%	0.60%	3.19%	0.23%	-1.14%	0.37%
过去一年	11.46%	0.56%	6.15%	0.21%	5.31%	0.35%
过去三年	19.08%	0.56%	16.92%	0.21%	2.16%	0.35%
过去五年	20.99%	0.50%	19.03%	0.22%	1.96%	0.28%
过去七年	40.60%	0.48%	35.84%	0.23%	4.76%	0.25%
自基金转型日起至今	44.06%	0.45%	47.11%	0.23%	-3.05%	0.22%

中信建投稳利 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.07%	0.55%	3.30%	0.26%	-3.37%	0.29%
过去六个月	1.85%	0.60%	3.19%	0.23%	-1.34%	0.37%
过去一年	11.01%	0.56%	6.15%	0.21%	4.86%	0.35%
过去三年	17.65%	0.56%	16.92%	0.21%	0.73%	0.35%
过去五年	18.59%	0.50%	19.03%	0.22%	-0.44%	0.28%
过去七年	36.68%	0.48%	35.84%	0.23%	0.84%	0.25%
自基金转型日起至今	36.73%	0.47%	35.87%	0.23%	0.86%	0.24%

3.2.2 自基金转型以来基金份额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 2026 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 2026 年 06 月 30 日。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中信建投基金管理有限公司（以下简称“中信建投基金”）于 2013 年 9 月 9 日在北京成立，注册资本 4.5 亿元，中信建投证券股份有限公司全资控股。中信建投基金主要经营公开募集证券投资基金管理、私募资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，中信建投基金在管公募证券投资基金共 71 只。

中信建投基金以公募基金为业务本源，以专户业务为服务抓手，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，不断提升主动投资管理能力。同时，中信建投基金加强客户体系建设，积极拓展渠道，加大与国有大行、股份制银行、证券公司以及保险机构的合作力度。中信建投基金各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

中信建投基金作为基金管理公司，秉承“忠于信，健于投”，追求以稳健的投资，回馈于客户的信任；致力于经过长期努力，打造具有影响力的品牌。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	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、兼任指数与量化投资部行政负责人	2023-08-11	-	14 年	中国籍，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，兼任指数与量化投资部行政负责人、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、中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金、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、中信建投双和债券型证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理/基金经理助理任职日期、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遵规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内经济整体保持稳健运行，但内部结构分化明显。从总量看，一季度 GDP 同比增长 5.4%，二季度增速虽有所回落但仍处于适度水平；从结构看，生产端强于需求端，外需强于内需，高技术产业强于传统产业。外贸是最大亮点，二季度进出口同比增长 18.4%，为 2021 年三季度以来最高增速，AI 硬件与新能源车出海为核心拉动。与之相对，内需仍受房地产开发投资持续拖累，居民与企业信用分化进一步显性化。价格指数方面，PPI 同比转正后持续上行，二季度已达 4.1%，而 CPI 温和运行在 1.0%附近，剪刀差扩大反映输入型涨价向下游传导不畅。从国际环境看，美国经济增长动力减弱，通胀粘性超出市场预期。美联储 1 月、3 月连续两次维持利率不变，6 月议息会议连续第四次按兵不动，联邦基金利率目标区间维持在 3.50%-3.75%，点阵图显示 18 名官员中 9 人预

计2026年内至少加息一次，2026年底利率中值由3.4%上修至3.8%，PCE预期由2.7%大幅上调至3.6%，紧缩预期再度升温。地缘政治方面，中东军事冲突在 3 月骤然升级一度推高油价，4 月美伊签署谅解备忘录后油价回落，但全球滞胀风险与流动性收紧预期贯穿上半年。

回顾上半年 A 股市场，整体呈现极致分化的结构性行情，宽基指数涨幅温和，而创业板指、科创综指等表现抢眼。行业层面分化极为显著：电子、通信等科技成长板块受到资金追捧涨幅居前，而商贸零售、农林牧渔、美容护理等传统行业持续调整。个股层面，翻倍股主要集中在半导体、电子化学品、光学光电子等与人工智能密切相关的细分领域。

可转债上半年指数震荡上行、但内部分化剧烈、同时估值居高不下。中证转债指数累计上涨 2.51%，呈现震荡上行格局，但内部结构性机会迭出——这既是 A 股结构性行情的映射，也受到转债自身供需格局变化的深刻影响：横向比较来看，转债表现优于中证全债和上证 50，但显著弱于科创 50、万得全 A 以及沪深 300 等宽基指数。在这个背景下，我们在市场风险提升的时候关注价格、隐含波动率等估值因子，降低了高价转债的配置，降低高估值高价的偏科技类转债，从中长期来看，坚持合理估值的长期配置思路，更具有风险收益比。在权益市场的推动下，转债估值已经达到近五年的高位。在这种背景下，需要适度容忍短期相对跑输市场的阶段性表现，严格遵循以转债绝对估值为核心的投资策略。

本基金将继续秉持“长期可持续盈利”的投资理念，在复杂市场中积极寻找高性价比的资产。股票资产将从单纯的估值修复和预期驱动，逐步转向业绩验证与成长持续性的甄别方向。我们将维持中性偏积极的仓位。固收及可转债资产方面，整体将以中低价格、高性价比的平衡型转债为核心，严格控制高价、高溢价品种的敞口。

4.4.2 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 1.4891 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.05%，同期业绩比较基准收益率为3.19%；截至报告期末中信建投稳利C基金份额净值为1.3673元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.85%，同期业绩比较基准收益率为 3.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年三季度，我们认为 A 股有望延续震荡上行态势，结构性机会依然丰富，但市场关注的焦点将从“讲故事”逐步转向“看业绩”。结合上半年运作的经验与当前宏观环境的变化，我们对下一阶段的投资判断如下：宏观与流动性层面，海外滞胀矛盾切换，国内政策效能持续释放。海外方面，地缘与美联储路径仍是主要扰动。美联储 6 月点阵图显示加息预期升温，但若美国“滞胀”矛盾逐步从“胀”切向“滞”，紧缩预期存在回摆空间。我们认为，伴随俄乌、美伊等地缘事件的风险外溢，全球能源安全可能会导致通胀压力上升，从而中断美联储的降息进程，但新兴市场估值修复的方向并未逆转。国内方面，超长期特别国债（1.3 万亿）与“反内卷”政策累积效应有望推动企业盈利预期从分化走向收敛，房地产等领域的结构性问题仍将制约反弹高度。产业趋势层面：AI 主线深化，从硬件基础设施向商业应用端延伸。产业趋势依然清晰，以 AI 为代表的科技创新正从硬件基础设施向商业应用端深化，半导体、算力等产业链业绩确定性较高，继续为经济增长提供核心动力。但需要警惕的是，与 2025 年不同，资本市场对于 AI 企业高资本开支的关注会提升，同

时也会更加关注企业收入的兑现可能；另一方面，存在被人工智能发展所替代可能性的行业或公司，面临着估值下调的风险。“十五五”规划方向或将成为市场焦点，人工智能、高端制造、新能源、自主可控等方向值得重点关注。此外，在“反内卷”政策以及经济回暖预期下，钢铁、有色金属等顺周期行业可能持续受益。与此同时，我们也将密切关注以下风险因素：一是海外经济下行超预期可能引发外部需求大幅收缩；二是地缘政治风险出现反复，对全球供应链造成冲击；三是美联储政策若超预期转向紧缩，可能引发全球资产价格剧烈调整；四是国内经济修复不及预期，特别是内需和地产恢复力度低于预期；五是科技板块估值与业绩兑现之间的错配可能引发结构性回调。总体而言，我们对中长期保持乐观态度。中国经济正在经历深刻的转型升级期，科技创新驱动增长的新动能正在积聚，权益市场的长期配置价值依然突出。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括权益投资相关部门、固定收益部、多元资产配置部、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、风险管理部、运营管理部的部门负责人。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策和执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法律及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 人的情形。

本基金 2025 年 12 月 16 日至 2026 年 2 月 10 日连续二十个工作日以上基金资产净值低于 5000 万元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在托管中信建投稳利混合型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议约定，对本基金的投资运作进行了监督，为本基金独立建账、独立核算、独立估值，按照托管协议约定的频率与管理人进行账务核对，本报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，本基金托管人在能够知悉和掌握的信息范围内，按照国家法律法规规定、基金合同和托管协议约定，复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明”、“关联方报酬-应支付销售机构的客户维护费”、“关联方报酬-销售服务费”、“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告相关内容，复核内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中信建投稳利混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	47,305,180.41	8,137,830.65
结算备付金		376,313.40	309,099.37
存出保证金		71,692.51	71,737.19
交易性金融资产	6.4.7.2	143,617,924.85	41,895,690.50
其中：股票投资		65,893,944.43	8,473,444.19
基金投资		-	-
债券投资		77,723,980.42	33,422,246.31
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	12,000,000.00	-
应收清算款		473,745.80	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,198.04	94,298.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		203,848,055.01	50,508,655.80
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 06 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		39,099,556.55	5,701,021.53
应付赎回款		108,909.70	225,450.93
应付管理人报酬		60,092.13	25,662.03
应付托管费		10,015.36	4,276.97
应付销售服务费		23,648.05	2,074.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,535.84	3,481.28
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	156,055.28	137,362.01
负债合计		39,463,812.91	6,099,329.16
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	116,960,752.28	30,492,514.45
未分配利润	6.4.7.8	47,423,489.82	13,916,812.19
净资产合计		164,384,242.10	44,409,326.64
负债和净资产总计		203,848,055.01	50,508,655.80

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 117,289,805.27 份，其中中信建投稳利 A 类基金份额净值 1.4891 元，基金份额 32,918,318.52 份；中信建投稳利 C 类基金份额净值 1.3673 元，基金份额 84,371,486.75 份。

6.2 利润表

会计主体：中信建投稳利混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至

		2026年06月30日	2025年06月30日
一、营业总收入		-945,299.00	2,637,468.14
1.利息收入		20,385.97	15,661.17
其中：存款利息收入	6.4.7.9	20,385.97	15,661.17
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,218,269.49	1,994,153.54
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,466,037.96	822,240.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,071,144.30	1,088,620.71
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.12	681,087.23	83,292.01
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-4,206,083.26	620,677.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	22,128.80	6,976.24
减：二、营业总支出		317,289.22	261,988.64
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	205,315.62	165,837.85
2.托管费	6.4.10.2.2	34,219.34	27,639.67
3.销售服务费	6.4.10.2.3	48,795.67	22,209.03
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		317.81	-
其中：卖出回购金融资产支出		317.81	-
6.信用减值损失	6.4.7.15	-	-
7.税金及附加		693.89	602.27
8.其他费用	6.4.7.16	27,946.89	45,699.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,262,588.22	2,375,479.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,262,588.22	2,375,479.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,262,588.22	2,375,479.50

6.3 净资产变动表

会计主体：中信建投稳利混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	30,492,514.45	13,916,812.19	44,409,326.64
二、本期期初净资产	30,492,514.45	13,916,812.19	44,409,326.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	86,468,237.83	33,506,677.63	119,974,915.46
（一）、综合收益总额	-	-1,262,588.22	-1,262,588.22
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	86,468,237.83	34,769,265.85	121,237,503.68
其中：1.基金申购款	101,411,726.69	41,883,423.82	143,295,150.51
2.基金赎回款	-14,943,488.86	-7,114,157.97	-22,057,646.83
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	116,960,752.28	47,423,489.82	164,384,242.10
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	36,567,914.34	9,992,979.90	46,560,894.24
二、本期期初净资产	36,567,914.34	9,992,979.90	46,560,894.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	9,608,556.12	5,386,118.66	14,994,674.78
（一）、综合收益总额	-	2,375,479.50	2,375,479.50
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	9,608,556.12	3,010,639.16	12,619,195.28
其中：1.基金申购款	23,856,239.62	6,228,858.14	30,085,097.76
2.基金赎回款	-14,247,683.50	-3,218,218.98	-17,465,902.48
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	46,176,470.46	15,379,098.56	61,555,569.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

金强	张欣宇	谭保民
————————	————————	————————

基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信建投稳利混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由中信建投稳利保本混合型证券投资基金转型而来。中信建投稳利保本混合型证券投资基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司于 2018 年 10 月 9 日发布《关于中信建投稳利保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及中信建投稳利混合型证券投资基金转型运作后相关业务规则的公告》。根据公告，中信建投稳利保本混合型证券投资基金转型为非保本的混合型证券投资基金，基金名称相应变更为“中信建投稳利混合型证券投资基金”，中信建投稳利保本混合型证券投资基金份额转换为中信建投稳利混合型证券投资基金份额。转型后，基金的托管人、登记机构、基金代码不变。自 2018 年 10 月 18 日起《中信建投稳利混合型证券投资基金基金合同》、《中信建投稳利混合型证券投资基金托管协议》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司，基金托管人为北京银行股份有限公司。

根据《关于中信建投稳利混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并调整基金合同和托管协议中相关条款的公告》，自 2019 年 1 月 4 日起，本基金增加 C 类基金份额类别，本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金 A 类基金份额。增加基金份额类别后，本基金分设 A 类、C 类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。本基金根据申购费、销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中：在投资者申购时收取申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额。从本类别基金资产中计提销售服务费而在投资者申购时不收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投稳利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具，债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-40%；其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。中小企业私募债占基金资产净值的比例不超过 20%；权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%；每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富指数收益率×80%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会

计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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信息披露内容与格式准则第 2 号-定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号-年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工

具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（4）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（5）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（6）公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额形成的应计入当期损益的利得或损失；

（7）其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

（2）能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

（3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

（1）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，

自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕140 号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78号《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132号《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2012〕85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2015〕101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	47,305,180.41
等于：本金	47,302,736.95
加：应计利息	2,443.46
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

合计	47,305,180.41

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		68,201,426.33	-	65,893,944.43	-2,307,481.90
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	79,183,556.41	502,850.55	77,723,980.42	-1,962,426.54
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	79,183,556.41	502,850.55	77,723,980.42	-1,962,426.54
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		147,384,982.74	502,850.55	143,617,924.85	-4,269,908.44

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	12,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	12,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末

	2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	36.61
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	118,371.18
其中：交易所市场	118,371.18
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	37,647.49
合计	156,055.28

6.4.7.7 实收基金

中信建投稳利 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,690,632.95	26,423,738.74
本期申购	13,523,989.43	13,388,821.54
本期赎回（以“-”号填列）	-7,296,303.86	-7,223,294.75
本期末	32,918,318.52	32,589,265.53

中信建投稳利 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,068,775.71	4,068,775.71
本期申购	88,022,905.15	88,022,905.15
本期赎回（以“-”号填列）	-7,720,194.11	-7,720,194.11
本期末	84,371,486.75	84,371,486.75

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

6.4.7.8 未分配利润

中信建投稳利 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,750,754.54	-3,227,430.70	12,523,323.84
本期期初	15,750,754.54	-3,227,430.70	12,523,323.84
本期利润	2,332,328.59	-1,858,121.62	474,206.97
本期基金份额交易产生的变动数	4,248,824.00	-816,396.61	3,432,427.39

其中：基金申购款	8,880,754.79	-1,459,264.12	7,421,490.67
基金赎回款	-4,631,930.79	642,867.51	-3,989,063.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,331,907.13	-5,901,948.93	16,429,958.20

中信建投稳利C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,720,355.00	-326,866.65	1,393,488.35
本期期初	1,720,355.00	-326,866.65	1,393,488.35
本期利润	611,166.45	-2,347,961.64	-1,736,795.19
本期基金份额交易产生的变动数	39,962,766.76	-8,625,928.30	31,336,838.46
其中：基金申购款	43,674,394.58	-9,212,461.43	34,461,933.15
基金赎回款	-3,711,627.82	586,533.13	-3,125,094.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,294,288.21	-11,300,756.59	30,993,531.62

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	19,671.51
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	489.54
其他	224.92
合计	20,385.97

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	167,670,813.10
减：卖出股票成本总额	165,920,513.70
减：交易费用	284,261.44
买卖股票差价收入	1,466,037.96

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日

债券投资收益——利息收入	275,363.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	795,781.18
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,071,144.30

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	74,646,267.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	73,313,977.00
减：应计利息总额	532,650.62
减：交易费用	3,858.37
买卖债券差价收入	795,781.18

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	681,087.23
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	681,087.23

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-4,206,083.26
——股票投资	-2,485,997.45
——债券投资	-1,720,085.81
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动	-

产生的预估增值税	
合计	-4,206,083.26

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	22,128.80
合计	22,128.80

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额中归入基金资产的比例按持有期间递减且不低于 25%。

6.4.7.15 信用减值损失

无。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	2,479.70
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
汇划手续费	672.00
合计	27,946.89

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构

北京银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一控股股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	392,972,883.37	100.00%	196,358,274.91	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	193,144,403.03	100.00%	162,808,245.75	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	22,000,000.00	100.00%	1,300,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	175,227.39	100.00%	118,371.18	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	87,556.73	100.00%	49,732.88	100.00%

注：1、上述佣金按本基金的基金管理人与对方协商确定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司代收的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	205,315.62	165,837.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	56,781.14	44,887.75
应支付基金管理人的净管理费	148,534.48	120,950.10

注：支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管	34,219.34	27,639.67

费		

注：支付基金托管人北京银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投稳利 A	中信建投稳利 C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	13,941.39	13,941.39
中信建投证券股份有限公司	-	10,699.94	10,699.94
合计	-	24,641.33	24,641.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投稳利 A	中信建投稳利 C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	2,442.47	2,442.47
中信建投证券股份有限公司	-	364.42	364.42
合计	-	2,806.89	2,806.89

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中信建投基金管理有限公司，再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.40%。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日 C 类基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
北京银行股份有限公司	47,305,180.41	19,671.51	9,176,134.38	15,311.02

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行股份有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601369	陕鼓动力	2026-06-29	重大事项	9.05	2026-07-13	9.96	119,200	1,056,842.23	1,078,760.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理

人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、风险管理部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他拥有相关资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场等场外市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	11,154,840.42	7,258,896.03
AAA 以下	19,650,813.82	20,616,811.24
未评级	-	-
合计	30,805,654.24	27,875,707.27

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12（如有）。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透

原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	47,305,180.41	-	-	-	47,305,180.41
结算备付金	376,313.40	-	-	-	376,313.40
存出保证金	71,692.51	-	-	-	71,692.51
交易性金融资产	23,505,173.15	54,211,952.23	6,855.04	65,893,944.43	143,617,924.85
买入返售金融资产	12,000,000.00	-	-	-	12,000,000.00
应收清算款	-	-	-	473,745.80	473,745.80
应收申购款	-	-	-	3,198.04	3,198.04
资产总计	83,258,359.47	54,211,952.23	6,855.04	66,370,888.27	203,848,055.01
负债					
应付清算款	-	-	-	39,099,556.55	39,099,556.55
应付赎回款	-	-	-	108,909.70	108,909.70
应付管理人报酬	-	-	-	60,092.13	60,092.13
应付托管费	-	-	-	10,015.36	10,015.36
应付销售服务	-	-	-	23,648.05	23,648.05

费					
应交税费	-	-	-	5,535.84	5,535.84
其他负债	-	-	-	156,055.28	156,055.28
负债总计	-	-	-	39,463,812.91	39,463,812.91
利率敏感度缺口	83,258,359.47	54,211,952.23	6,855.04	26,907,075.36	164,384,242.10
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	8,137,830.65	-	-	-	8,137,830.65
结算备付金	309,099.37	-	-	-	309,099.37
存出保证金	71,737.19	-	-	-	71,737.19
交易性金融资产	16,390,321.98	16,726,198.58	305,725.75	8,473,444.19	41,895,690.50
应收申购款	-	-	-	94,298.09	94,298.09
资产总计	24,908,989.19	16,726,198.58	305,725.75	8,567,742.28	50,508,655.80
负债					
应付清算款	-	-	-	5,701,021.53	5,701,021.53
应付赎回款	-	-	-	225,450.93	225,450.93
应付管理人报酬	-	-	-	25,662.03	25,662.03
应付托管费	-	-	-	4,276.97	4,276.97
应付销售服务费	-	-	-	2,074.41	2,074.41
应交税费	-	-	-	3,481.28	3,481.28
其他负债	-	-	-	137,362.01	137,362.01
负债总计	-	-	-	6,099,329.16	6,099,329.16
利率敏感度缺口	24,908,989.19	16,726,198.58	305,725.75	2,468,413.12	44,409,326.64

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	287,904.79	118,833.20
	市场利率上升 25 个基点	-285,745.93	-117,877.65

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	65,893,944.43	40.09	8,473,444.19	19.08
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	30,805,654.24	18.74	27,875,707.27	62.77
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	96,699,598.67	58.83	36,349,151.46	81.85

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	14,443,143.58	4,700,497.03
	业绩比较基准下降 5%	-14,443,143.58	-4,700,497.03

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低

层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	95,620,838.67	36,048,170.42
第二层次	47,997,086.18	5,847,520.08
第三层次	-	-
合计	143,617,924.85	41,895,690.50

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	65,893,944.43	32.33
	其中：股票	65,893,944.43	32.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	77,723,980.42	38.13
	其中：债券	77,723,980.42	38.13
	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	12,000,000.00	5.89
	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	47,681,493.81	23.39
8	其他各项资产	548,636.35	0.27
9	合计	203,848,055.01	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	2,422,507.00	1.47
C	制造业	23,497,459.03	14.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,235,172.00	1.97
E	建筑业	3,294,252.00	2.00
F	批发和零售业	900,552.00	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	5,019,600.00	3.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,667,494.40	1.62
J	金融业	22,634,116.00	13.77
K	房地产业	1,222,312.00	0.74
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,000,480.00	0.61
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	65,893,944.43	40.09

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	605377	华旺科技	186,600	1,735,380.00	1.06
2	601963	重庆银行	148,800	1,499,904.00	0.91
3	600750	华润江中	67,500	1,489,725.00	0.91
4	600863	华能蒙电	313,600	1,473,920.00	0.90
5	601009	南京银行	144,400	1,428,116.00	0.87
6	601838	成都银行	75,300	1,332,810.00	0.81
7	600350	山东高速	118,200	1,315,566.00	0.80
8	601825	沪农商行	174,000	1,303,260.00	0.79
9	600502	安徽建工	299,400	1,302,390.00	0.79
10	600919	江苏银行	115,700	1,247,246.00	0.76
11	600007	中国国贸	64,400	1,222,312.00	0.74
12	601857	中国石油	139,900	1,214,332.00	0.74
13	600938	中国海油	44,500	1,208,175.00	0.73
14	601577	长沙银行	138,300	1,204,593.00	0.73
15	601077	渝农商行	187,100	1,143,181.00	0.70
16	600015	华夏银行	176,900	1,130,391.00	0.69
17	601107	四川成渝	227,800	1,111,664.00	0.68
18	601187	厦门银行	158,200	1,080,506.00	0.66
19	601369	陕鼓动力	119,200	1,078,760.00	0.66
20	600820	隧道股份	204,800	1,067,008.00	0.65
21	600352	浙江龙盛	88,000	1,065,680.00	0.65
22	600461	洪城环境	114,600	1,038,276.00	0.63
23	601988	中国银行	180,000	1,029,600.00	0.63
24	601998	中信银行	148,400	1,028,412.00	0.63
25	601939	建设银行	104,300	1,004,409.00	0.61
26	601717	中创智领	72,200	1,004,302.00	0.61
27	601665	齐鲁银行	172,300	994,171.00	0.60
28	600036	招商银行	27,600	979,800.00	0.60
29	600012	皖通高速	61,600	970,816.00	0.59
30	600873	梅花生物	128,700	945,945.00	0.58

31	601398	工商银行	131,800	931,826.00	0.57
32	601328	交通银行	144,300	927,849.00	0.56
33	601668	中国建筑	213,100	924,854.00	0.56
34	600016	民生银行	287,000	924,140.00	0.56
35	600582	天地科技	205,500	914,475.00	0.56
36	601658	邮储银行	184,000	907,120.00	0.55
37	600710	苏美达	94,200	900,552.00	0.55
38	601318	中国平安	18,800	897,512.00	0.55
39	600941	中国移动	10,000	861,300.00	0.52
40	600887	伊利股份	35,200	843,392.00	0.51
41	603323	苏农银行	217,800	842,886.00	0.51
42	600035	楚天高速	248,400	837,108.00	0.51
43	600737	中粮糖业	66,600	821,178.00	0.50
44	601288	农业银行	131,200	796,384.00	0.48
45	600377	宁沪高速	67,800	784,446.00	0.48
46	600008	首创环保	265,800	722,976.00	0.44
47	688187	时代电气	10,200	700,332.00	0.43
48	688120	华海清科	1,760	567,036.80	0.34
49	688233	神工股份	2,600	557,492.00	0.34
50	688017	绿的谐波	1,200	501,432.00	0.31
51	688008	澜起科技	1,600	495,840.00	0.30
52	688777	中控技术	4,200	493,500.00	0.30
53	688003	天准科技	3,800	483,740.00	0.29
54	688200	华峰测控	896	470,489.60	0.29
55	688766	普冉股份	600	459,960.00	0.28
56	688037	芯源微	1,000	439,050.00	0.27
57	688179	阿拉丁	15,400	426,734.00	0.26
58	688234	天岳先进	2,400	416,424.00	0.25
59	688525	佰维存储	800	395,784.00	0.24
60	688531	日联科技	2,200	391,248.00	0.24
61	688519	南亚新材	1,000	380,040.00	0.23
62	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.23
63	688012	中微公司	800	374,800.00	0.23
64	688301	奕瑞科技	2,920	362,080.00	0.22
65	688059	华锐精密	1,800	359,478.00	0.22
66	688127	蓝特光学	3,600	351,360.00	0.21
67	688188	柏楚电子	3,240	345,708.00	0.21
68	688170	德龙激光	3,600	345,636.00	0.21
69	688097	博众精工	5,400	340,470.00	0.21
70	688002	睿创微纳	2,200	340,318.00	0.21
71	688206	概伦电子	7,200	319,464.00	0.19
72	688049	炬芯科技	6,400	300,224.00	0.18
73	688372	伟测科技	1,600	297,600.00	0.18

74	688185	康希诺	5,800	295,742.00	0.18
75	688696	极米科技	4,400	283,976.00	0.17
76	688025	杰普特	600	282,000.00	0.17
77	688266	泽璟制药	2,400	279,984.00	0.17
78	688222	成都先导	8,600	276,146.00	0.17
79	688629	华丰科技	1,400	262,514.00	0.16
80	688390	固德威	2,200	238,722.00	0.15
81	688702	盛科通信	600	233,994.00	0.14
82	688411	海博思创	800	232,960.00	0.14
83	688636	智明达	6,400	231,872.00	0.14
84	688521	芯原股份	600	222,684.00	0.14
85	688313	仕佳光子	1,200	221,580.00	0.13
86	688183	生益电子	1,600	211,840.00	0.13
87	688013	天臣医疗	8,400	207,228.00	0.13
88	688676	金盘科技	2,400	203,136.00	0.12
89	688027	国盾量子	400	201,604.00	0.12
90	688388	嘉元科技	4,430	194,920.00	0.12
91	688258	卓易信息	1,600	189,664.00	0.12
92	688698	伟创电气	3,400	178,330.00	0.11
93	688510	航亚科技	7,200	171,936.00	0.10
94	688778	厦钨新能	3,000	163,200.00	0.10
95	688543	国科军工	4,000	157,800.00	0.10
96	688717	艾罗能源	1,600	132,112.00	0.08
97	688608	恒玄科技	80	13,375.20	0.01
98	688625	呈和科技	80	6,752.80	0.00
99	688800	瑞可达	56	5,374.32	0.00
100	603650	彤程新材	43	4,213.14	0.00
101	688606	奥泰生物	87	3,573.96	0.00
102	301221	光庭信息	40	1,180.40	0.00
103	605305	中际联合	25	1,048.00	0.00
104	605319	无锡振华	40	907.60	0.00
105	600885	宏发股份	25	862.25	0.00
106	601636	旗滨集团	30	306.90	0.00
107	601689	拓普集团	3	169.26	0.00
108	600356	恒丰纸业	20	148.20	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600750	华润江中	2,548,374.00	5.74

2	600863	华能蒙电	1,875,254.00	4.22
3	601963	重庆银行	1,810,726.52	4.08
4	605377	华旺科技	1,797,213.20	4.05
5	601009	南京银行	1,713,328.00	3.86
6	600502	安徽建工	1,670,237.00	3.76
7	601825	沪农商行	1,591,841.00	3.58
8	600938	中国海油	1,558,371.00	3.51
9	600007	中国国贸	1,509,810.00	3.40
10	601838	成都银行	1,498,112.00	3.37
11	601857	中国石油	1,493,774.00	3.36
12	600496	精工钢构	1,473,964.00	3.32
13	688002	睿创微纳	1,449,743.85	3.26
14	600919	江苏银行	1,432,848.00	3.23
15	600350	山东高速	1,415,808.00	3.19
16	601577	长沙银行	1,390,337.00	3.13
17	600710	苏美达	1,364,652.00	3.07
18	601077	渝农商行	1,350,951.00	3.04
19	601107	四川成渝	1,340,181.00	3.02
20	601369	陕鼓动力	1,330,908.00	3.00
21	600015	华夏银行	1,313,525.00	2.96
22	688127	蓝特光学	1,310,635.10	2.95
23	002236	大华股份	1,275,148.00	2.87
24	601717	中创智领	1,226,523.00	2.76
25	600820	隧道股份	1,225,358.00	2.76
26	603588	高能环境	1,219,897.20	2.75
27	601998	中信银行	1,207,867.00	2.72
28	688200	华峰测控	1,199,345.65	2.70
29	603599	广信股份	1,191,570.00	2.68
30	600012	皖通高速	1,190,306.00	2.68
31	600461	洪城环境	1,189,883.00	2.68
32	601187	厦门银行	1,188,185.00	2.68
33	600873	梅花生物	1,183,325.00	2.66
34	601988	中国银行	1,182,029.00	2.66
35	601939	建设银行	1,150,452.00	2.59
36	600016	民生银行	1,138,056.00	2.56
37	600036	招商银行	1,137,490.00	2.56
38	601108	财通证券	1,134,341.00	2.55
39	002284	亚太股份	1,124,693.00	2.53
40	601665	齐鲁银行	1,124,188.00	2.53
41	600582	天地科技	1,118,955.00	2.52
42	600801	华新建材	1,106,585.00	2.49
43	600352	浙江龙盛	1,103,894.00	2.49
44	603365	水星家纺	1,094,188.03	2.46

45	601668	中国建筑	1,082,641.00	2.44
46	601328	交通银行	1,062,035.00	2.39
47	601318	中国平安	1,060,407.00	2.39
48	601398	工商银行	1,057,159.00	2.38
49	600941	中国移动	1,028,846.00	2.32
50	600282	南钢股份	1,025,959.00	2.31
51	600035	楚天高速	1,006,189.00	2.27
52	000792	盐湖股份	1,005,862.00	2.26
53	601658	邮储银行	1,000,442.00	2.25
54	000100	TCL 科技	995,368.00	2.24
55	603876	鼎胜新材	974,793.00	2.20
56	603323	苏农银行	974,622.00	2.19
57	600887	伊利股份	960,249.00	2.16
58	600038	中直股份	943,313.00	2.12
59	600377	宁沪高速	932,822.00	2.10
60	601872	招商轮船	930,902.00	2.10
61	002922	伊戈尔	925,609.00	2.08
62	601288	农业银行	921,537.00	2.08
63	600166	福田汽车	910,113.00	2.05
64	600737	中粮糖业	906,274.00	2.04
65	603699	纽威股份	897,291.00	2.02

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600496	精工钢构	1,701,293.00	3.83
2	002236	大华股份	1,553,808.00	3.50
3	688002	睿创微纳	1,479,153.04	3.33
4	601108	财通证券	1,400,364.00	3.15
5	600801	华新建材	1,341,684.00	3.02
6	002487	大金重工	1,236,947.00	2.79
7	603365	水星家纺	1,232,463.00	2.78
8	603588	高能环境	1,227,175.00	2.76
9	603599	广信股份	1,193,100.00	2.69
10	688127	蓝特光学	1,162,489.54	2.62
11	600038	中直股份	1,093,219.00	2.46
12	002414	高德红外	1,086,879.00	2.45
13	600282	南钢股份	1,064,552.00	2.40
14	002284	亚太股份	1,059,336.00	2.39
15	601872	招商轮船	1,044,489.00	2.35
16	603259	药明康德	1,007,493.00	2.27

17	000792	盐湖股份	982,930.00	2.21
18	603699	纽威股份	981,018.00	2.21
19	688200	华峰测控	977,769.30	2.20
20	300017	网宿科技	963,190.00	2.17
21	000100	TCL 科技	954,496.00	2.15
22	002156	通富微电	952,906.00	2.15
23	300138	晨光生物	933,460.00	2.10
24	002922	伊戈尔	924,894.00	2.08
25	600166	福田汽车	922,435.00	2.08
26	603876	鼎胜新材	914,617.00	2.06
27	002008	大族激光	896,774.00	2.02
28	600507	方大特钢	893,755.00	2.01

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	225,827,011.39
卖出股票收入（成交）总额	167,670,813.10

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	46,918,326.18	28.54
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)	30,805,654.24	18.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	77,723,980.42	47.28

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019797	25 国债 24	327,050	33,011,692.26	20.08
2	019840	26 国债 11	139,000	13,906,633.92	8.46
3	128134	鸿路转债	14,810	1,758,311.98	1.07
4	110075	南航转债	15,270	1,674,879.91	1.02

5	127049	希望转 2	14,297	1,552,656.36	0.94

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 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贵金属投资明细

无。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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的发行主体中，重庆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重庆监管局、国家外汇管理局重庆市分局的处罚。

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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	71,692.51
2	应收清算款	473,745.80
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,198.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	548,636.35

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128134	鸿路转债	1,758,311.98	1.07
2	110075	南航转债	1,674,879.91	1.02
3	127049	希望转 2	1,552,656.36	0.94
4	123090	三诺转债	1,546,231.73	0.94
5	113616	韦尔转债	1,533,908.16	0.93
6	127027	能化转债	1,533,246.30	0.93
7	113052	兴业转债	1,494,962.51	0.91
8	128135	洽洽转债	1,477,342.89	0.90
9	113049	长汽转债	1,475,029.38	0.90
10	123113	仙乐转债	1,398,432.42	0.85
11	123104	卫宁转债	1,307,422.07	0.80
12	123071	天能转债	1,262,342.55	0.77
13	128129	青农转债	1,070,348.19	0.65
14	113037	紫银转债	1,034,715.90	0.63
15	127025	冀东转债	1,027,116.55	0.62
16	118034	晶能转债	892,124.14	0.54
17	113625	江山转债	862,030.69	0.52
18	127089	晶澳转债	811,410.68	0.49
19	118031	天 23 转债	781,389.02	0.48
20	113042	上银转债	763,616.54	0.46
21	118022	锂科转债	752,023.41	0.46
22	123119	康泰转 2	751,464.84	0.46
23	113605	大参转债	684,863.21	0.42
24	110087	天业转债	665,278.63	0.40
25	128125	华阳转债	575,198.54	0.35
26	127040	国泰转债	531,610.58	0.32
27	123076	强力转债	330,686.52	0.20

28	123107	温氏转债	296,431.56	0.18
29	127108	太能转债	291,606.79	0.18
30	128142	新乳转债	280,604.05	0.17
31	110093	神马转债	206,795.47	0.13
32	113627	太平转债	114,959.98	0.07
33	113051	节能转债	59,757.65	0.04

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信建投稳利 A	648	50,799.87	19,830,647.05	60.2420%	13,087,671.47	39.7580%
中信建投稳利 C	800	105,464.36	65,037,741.73	77.0850%	19,333,745.02	22.9150%
合计	1,422	82,482.28	84,868,388.78	72.3579%	32,421,416.49	27.6421%

注：持有人户数合计数少于各分项之和，系部分基金持有人持有多个份额类别基金所致。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	75.0774%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信建投稳利 A	52,868.91	0.1606%
	中信建投稳利 C	0.00	0.0000%
	合计	52,868.91	0.0451%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信建投稳利 A	0~10
	中信建投稳利 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投稳利 A	0~10
	中信建投稳利 C	0
	合计	0~10

§9 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
基金合同生效日（2018 年 10 月 18 日）基金份额总额	383,893,135.57	-
本报告期期初基金份额总额	26,690,632.95	4,068,775.71
本报告期基金总申购份额	13,523,989.43	88,022,905.15
减：本报告期基金总赎回份额	7,296,303.86	7,720,194.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	32,918,318.52	84,371,486.75

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2026 年 4 月 23 日，金强先生不再担任基金管理人总经理、副董事长，转任基金管理人董事长（法定代表人），黄凌先生不再担任基金管理人董事长（法定代表人）。自 2026 年 4 月 23 日起，金强先生代为履行基金管理人总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人未受调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生托管人受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券股份有限公司	2	392,972,883.37	100.00%	175,227.39	100.00%	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内，本基金租用的交易单元未发生变更。

2、根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》及《中信建投基金管理有限公司公募基金证券交易费用管理办法》，基金管理人选择证券公司参与证券交易的标准和程序如下：

（1）选择证券公司参与证券交易的标准

基金管理人根据自身合规风控能力、信息系统建设水平、运营及交易服务能力、研究服务能力、产

品管理规模等情况，审慎选择财务状况良好，经营稳健规范，系统运行安全，合规风控能力、运营及交易服务能力、研究服务能力较强的证券公司参与证券交易。

（2）选择证券公司参与证券交易的程序

基金管理人指定专人负责参与证券交易的证券公司的准入评估，并根据评估结果完成与证券公司的协议签订及交易佣金费率的确定等工作。基金管理人建立了“证券研究报告质量评分机制”“证券综合研究服务评分体系”等，每季度组织公募投研部门完成对已合作证券公司的研究服务打分评价，评价结果是确定/调整证券公司股票交易成交金额及佣金比例限制的参考。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	193,144,403.03	100.00%	22,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2026-01-22
2	中信建投稳利混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	规定网站	2026-01-22
3	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金增加广发银行股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2026-02-11
4	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊	2026-03-31
5	中信建投稳利混合型证券投资基金 2025 年年度报告	规定网站	2026-03-31
6	中信建投基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况公告（2025 年度）	规定网站	2026-03-31
7	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金	规定报刊	2026-04-22

	2026 年第 1 季度报告提示性公告		
8	中信建投稳利混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	规定网站	2026-04-22
9	中信建投基金管理有限公司董事长（法定代表人）、高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2026-04-25
10	中信建投基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定网站、规定报刊	2026-06-25
11	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	规定网站、规定报刊	2026-06-27
12	中信建投稳利混合型证券投资基金基金合同	规定网站	2026-06-27
13	中信建投稳利混合型证券投资基金托管协议	规定网站	2026-06-27

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20260605-20260630	0.00	28,752,156.41	0.00	28,752,156.41	24.5138%
	2	20260101-20260129	10,044,769.71	3,858,125.92	4,500,000.00	9,402,895.63	8.0168%
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。							

11.2 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。

§12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所。

12.3 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

二〇二六年八月三十一日