

中信建投基金周周鑫 1 号集合资产管理计划 2026 年第二季度报告

资产管理人：中信建投基金管理有限公司
资产托管人：青岛银行股份有限公司
报告送出日期：2026 年 07 月 31 日

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 26 日取得中国证券监督管理委员会核发的《基金管理资格证书》，秉承恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则，规范化、市场化、专业化运作私募资产管理业务。

报告期内，中信建投基金就旗下私募资产管理业务中，资产管理计划委托财产的财务指标、投资组合情况、业绩表现、风险状况做专项说明，具体情况如下：

一、重要提示

本资产管理人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。由于四舍五入的原因，本报告数据中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

本资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托资产，但不保证委托财产一定盈利。委托财产的过往业绩并不代表其未来表现。

本资产管理人、本资产托管人在资产管理合同中充分揭示了管理、运用委托财产进行投资可能面临的风险，投资者充分理解相关权利及义务，愿意承担相应的投资风险。

本报告中财务资料未经审计师审计。

本报告期自 2026 年 04 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日。

二、管理人履职报告

2.1 投资经理简介

刘洋，东北大学管理科学与工程学博士，曾就职于华夏证券沈阳中街路营业部任客户经理；北京大学博士后期间从事应用经济学研究工作；嘉实基金任基金经理；中融基金、光大理财任投资经理。2023 年 6 月加入中信建投基金管理有限公司，现任中信建投基金管理有限公司特定资产管理部投资经理，特定资产管理部行政负责人。

本计划投资经理已经依法取得基金从业资格，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚，无对外兼职情况。

2.2 管理人对报告期内本投资组合运作合规守信情况的说明

本报告期内，本资产管理人严格遵守了《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托资产，在控制和防范风险的前提下，为投资者谋求最大的利益。

2.3 公平交易与异常交易专项说明

2.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期本资产管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定，各投资组合在研究支持、投资决策、交易执行上享有公平的机会。

公司严格执行了公平交易分配制度和公平交易程序，保证各投资组合获得了公平的交易机会。

2.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期公司内部风险控制和监察稽核工作中未发现异常交易行为，未发现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的行为。

三、托管人履职报告

3.1 托管人对报告期内本投资组合运作合规守信情况的说明

本报告期内，本资产管理计划托管人在对本计划的托管过程中，已遵守法律法规和资产管理合同的有关规定，履行了托管人监督职责，资产管理人在本资产管理计划中的投资运作符合法律法规和资产管理合同的规定，不存在损害投资者利益的行为。

3.2 托管人对本报告期内财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对本报告中投资表现、投资组合情况、相关产品费用支付及收益分配情况（如有）等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

四、资产管理计划投资表现

本资产管理计划报告期的主要财务指标和业绩表现情况：见表 1 和表 2

五、资产管理计划投资组合情况

截至报告期期末，本资产管理计划投资组合情况：见表 3

截至报告期期末，本资产管理计划按占资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细：见表 4

截至报告期期末，本资产管理计划按占资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细：见表 5

截至报告期期末，本资产管理计划按占资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细：见表 6

截至报告期期末，本资产管理计划按占资产净值比例大小排序的前十名资管产品（不含公募基金）投资明细：见表 7

截至报告期期末，本资产管理计划按占资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细：见表 8

六、资产管理计划运用杠杆情况（如有）

本报告期内，本计划未运用杠杆。

七、资产管理计划支付的固定管理费、业绩报酬（如有）、托管费等费用的计提基准、计提方式和支付方式

截至报告期期末，本资产管理计划支付的固定管理费、业绩报酬（如有）、托管费等费用的计提基准、计提方式和支付方式：见表 9

八、资产管理计划投资收益分配情况

截至报告期期末，本资产管理计划投资收益分配情况：见表 10

九、投资经理变更、关联交易等涉及投资者权益的重大事项

9.1 投资经理变更

本报告期内，未发生投资经理变更。

9.2 关联交易

(1) 重大关联交易：无。

(2) 一般关联交易：无。

9.3 其他重大事项

本报告期内，未发生其他重大事项。

9.4 员工、配偶、实际控制人、关联方等持有公司私募资管产品的情况

无。

中信建投基金管理有限公司
2026 年 07 月 31 日

表 1： 本资产管理计划二季度主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	2026年04月01日-2026年06月30日
本期利润	31,369.36
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	800.14
期末资产净值	10,091,759.81
期末份额净值	1.0092
初始投资金额	11,300,167.21
期间内累计追加份额	—
期间内累计提取份额	—

表 2： 本资产管理计划二季度业绩表现

本报告期期间份额净值增长率	0.32%
自本资产管理计划成立日至本报告期期末份额净值增长率	0.92%

表 3： 本资产管理计划二季度投资组合情况

序号	资产类别	估值市值（元）	占产品总资产比例（%）
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	2,046,194.32	20.25
6	基金投资	8,056,346.16	79.75
7	其他资产	—	—
8	合计	10,102,540.48	100.00

表 4：截至报告期期末，本资产管理计划按占产品资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本计划本报告期末未持有股票。

表 5：截至报告期期末，本资产管理计划按占产品资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本计划本报告期末未持有债券。

表 6：截至报告期期末，本资产管理计划按占产品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	数量（份）	估值市值 （人民币元）	占产品资产净 值比例（%）
1	006389	金鹰添祥中短债A	886,121.95	1,009,647.35	10.0047
2	007603	景顺长城中短债债券A类	862,863.59	1,008,514.96	9.9934
3	006797	嘉实中短债债券A	867,129.26	1,007,777.63	9.9861
4	005350	诺德短债A	859,673.29	1,007,193.23	9.9804
5	000128	大成景安短融债券A	755,515.26	1,006,799.64	9.9765
6	006517	南方吉元短债债券A	913,643.46	1,006,652.36	9.9750
7	012773	嘉实超短债债券A	952,905.34	1,005,791.59	9.9665
8	019616	东财中证同业存单AA指数7天持有	968,147.93	1,003,969.40	9.9484

表 7：截至报告期期末，本资产管理计划按占产品资产净值比例大小排序的前十名资管产品（不含公募基金）投资明细

本计划本报告期末未持有资管产品（不含公募基金）。

表 8：截至报告期期末，本资产管理计划按占产品资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本计划本报告期末未持有资产支持证券。

表 9：截至报告期期末，本资产管理计划本报告期支付的固定管理费、业绩报酬（如有）、托管费等费用的计提基准、计提方式和支付方式

费用类别	本期计提额（元）	本期支付额（元）	计提基准、计提方式及支付方式
固定管理费	8,793.72	8,666.14	详见附注 1
业绩报酬	-	-	详见附注 2
托管费	251.16	247.57	详见附注 3

附注 1：

本计划的年固定管理费率为 0.35%，若本计划投资管理人管理的公开募集证券投资基金，则此处计划资产净值不包括所投资的公开募集证券投资基金的净值。计算方法如下：

$H = E \times \text{年固定管理费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的计划资产的固定管理费

E 为前一日的计划资产净值中扣除本计划持有的管理人管理的公开募集证券投资基金公允价值后的余额（若为负数，则取 0）

自本计划成立日起，每日计提，按自然季度支付。经资产管理人和资产托管人按照上述公式核对一致后，每自然季度季初 10 个工作日内由资产托管人从计划财产中划付至资产管理人指定账户。若遇不可抗力或计划财产不足支付致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。如本计划终止，终止日下一日起本计划不再计提固定管理费，依据清算程序支付管理人尚未收取的固定管理费。

附注 2：

本计划不收取业绩报酬。

附注 3：

本计划资产年托管费率为 0.01%。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的计划资产净值

自本计划成立日起，每日计提，按自然季度支付。经资产管理人和资产托管人按照上述公式核对一致后，每自然季度季初 10 个工作日内由资产托管人从计划财产中划付至资产托管人指定账户。若遇不可抗力或计划财产不足支付致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。如本计划终止，终止日下一日起本计划不再计提托管费，依据清算程序支付托管人尚未收取的托管费。

表 10：本资产管理计划投资收益分配情况

本报告期已分配利润总额（元）	-
本报告期每份额累计分配金额（元）	-