

中信建投基金-添翼目标盈 2 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。

冯天成，清华大学理学硕士。曾任北京聚光世达科技有限公司投融资助理，北京星石投资管理有限公司股票研究员，顺沅资产管理有限公司股票研究员。2020 年 6 月加入中信建投基金管理有限公司，曾任研究部股票研究员、基金经理助理，现任特定资产管理部投资经理。

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：本计划于 2026 年 5 月 25 日投资“中信建投悦享 6 个月持有期 A 基金” 2105218.96 元，管理人为中信建投基金管理有限公司。本计划管理人内部投资决策流程认定为一般关联交易。

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	511,929.77
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-933,337.71
期末资产净值	78,759,313.52
期末份额净值	0.9920
初始投资金额	30,400,003.88
期间内累计追加份额	30,001,006.75
期间内累计提取份额	30,000,000.00

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	0.66%
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	4.72%

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	6,820,740.40	8.64
	其中：股票	6,820,740.40	8.64
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	16,388,985.44	20.77
6	基金投资	55,693,658.12	70.58
7	其他资产	-	-
8	合计	78,903,383.96	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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	估值市值 （人民币元）	占产品资产净值比例（%）
1	920914	远航精密	27,800	511,520.00	0.65
2	688567	孚能科技	24,200	254,100.00	0.32
3	002483	润邦股份	51,400	253,916.00	0.32
4	300741	华宝股份	19,100	239,132.00	0.30
5	688489	三未信安	9,600	217,920.00	0.28
6	920266	生物谷	35,000	217,350.00	0.28
7	600456	宝钛股份	7,800	213,330.00	0.27
8	300213	佳讯飞鸿	26,300	159,378.00	0.20
9	600023	浙能电力	25,400	133,604.00	0.17
10	600218	全柴动力	16,500	119,130.00	0.15

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	006797	嘉实中短债债券A	5,207,013.28	6,051,590.83	7.6837
2	000128	大成景安短融债券A	3,780,146.67	5,037,423.45	6.3960
3	016752	中信建投景信债券A	4,489,184.04	4,539,013.98	5.7631
4	024971	东方红短债债券D	4,153,900.13	4,531,905.04	5.7541
5	012773	嘉实超短债债券A	4,100,993.55	4,328,598.69	5.4960
6	005079	兴银鑫日享短债A	3,809,868.09	4,158,852.01	5.2805

7	007245	安信鑫日享中短债A	3,478,215.53	4,045,512.48	5.1366
8	005513	南华瑞恒中短债债券A	2,762,132.90	3,028,126.30	3.8448
9	005350	诺德短债A	2,410,013.24	2,823,571.51	3.5851
10	006496	银华安盈短债债券A	1,926,927.39	2,134,264.78	2.7099

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	138,212.79	137,826.45	详见附注 1
业绩报酬	—	—	详见附注 2
托管费	1,974.45	1,968.92	详见附注 3

附注 1：

本计划的年固定管理费率为 0.7%。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

自计划成立日起，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支付的固定管理费。

附注 2：

业绩报酬的计提原则：本计划的业绩报酬在投资者部分或全部退出、本计划分红、本计划终止清算时针对退出份额、分红份额和终止清算份额计提。业绩报酬提取时点为退出确认日、分红确认日和计划终止清算日。本计划的业绩报酬计提基准为年化 4%，业绩报酬提取比例为 60%。

本计划在退出确认日提取的业绩报酬，从投资者的退出资金中扣除；在计划终止清算日提取的业绩报酬，从投资者的清算资金中扣除。计划分红时，单笔业绩报酬计提金额不超过分红金额，从分红资金中扣除。

如退出份额为一笔参与份额的一部分，则将该部分退出份额直接进行核算；若持有人在退出前多次参与，则退出时对份额采取“先进先出”的原则进行计算。当计划终止清算时，按规定对终止清算份额计提业绩报酬。

业绩报酬的计算公式：

$$1) \quad PF = \sum_{j=1}^n PF_j$$

$$2) \quad R = \frac{NAV_e - HWM_j}{HWM_j * T_j} * 365$$

$$3) \quad PF_j = \begin{cases} 0, & \text{当 } R \leq 4\% \\ (R - 4\%) * 60\% * \frac{HWM_j * T_j}{365} * F_j, & \text{当 } R > 4\% \end{cases}$$

其中：

PF ：投资者本次退出确认日/分红确认日/计划终止清算日计提的全部业绩报酬；

PF_j ：本计提日投资者第 j 笔投资的业绩报酬，其中分红时以该笔投资实际分红金额为限；

F_j ：退出确认日提取时，表示投资者退出份额中第 j 笔投资的计划份额；计划分红确认日提取时，表示投资者分红时持有的第 j 笔投资的计划份额；计划终止清算日提取时，表示投资者终止清算时持有的第 j 笔确认的计划份额；

NAV_e ：该投资者本次退出申请日/除权除息日/计划终止清算日的计划份额累计单位净值；

HWM_j ：第 j 笔投资的上一次计提业绩报酬日对应的计划份额累计单位净值；若该笔份额还未计提过业绩报酬，则为投资者第 j 笔投资参与时计划份额累计净值，如第 j 笔投资为认购取得的份额，则 HWM_j 为 1；

HWM'_j ：投资者第 j 笔投资的上一次计提业绩报酬日对应的计划份额净值；若该笔份额还未计提过业绩报酬，则为投资者第 j 笔投资参与时计划份额净值，如第 j 笔投资为认购取得的份额，则 HWM'_j 为 1；

T_j ：投资者第 j 笔投资参与份额确认日（如第 j 笔投资为认购取得的份额，则为计划成立日）与上一次计提业绩报酬日的孰后日至本次退出确认日/分红确认日/计划终止清算日之间的实际天数（算头不算尾）；

R ：投资者第 j 笔投资本次退出确认日/分红确认日/计划终止清算日距该笔份额参与确认日与上一次计提业绩报酬日的孰后日之间的年化收益率。

如果 PF_j 计算结果为负或者为零，则该计提日投资者第 j 笔投资提取的业绩报酬为零，计划管理人就该笔投资不提取业绩报酬。

退出确认日：对投资者退出份额金额确认的日期。

除权除息日：根据计划分红情况，对本次分红业务进行账务处理的日期，分红后除权除息日当天的计划份额净值可能下降。除权除息日具体以管理人发布分红公告或管理人按照资产管理合同约定的信息披露方式告知资产投资者的日期为准。

分红处理日：计划分红，对本次分红业务进行明细确认的日期。分红处理日具体以管理人发布分红公告或管理人按照资产管理合同约定的信息披露方式告知资产投资者的日期为准。

计划终止清算日：是指计划终止后，对计划财产逐次清算处理之日。

业绩报酬的支付由管理人向托管人发送划付指令，托管人根据划付指令从计划财产中支付给管理人。

重要提示：上述业绩计提基准、年化收益率的表述均为资产管理人计提业绩报酬的计算依据，不作为本计划管理人对计划未来收益的承诺和保证。

特别风险揭示及说明：

本计划从分红资金中连续两次计提业绩报酬基准日的间隔期应在 6 个月以上（包括本数），但因管理人在投资者退出计划份额时或在计划终止时计提业绩报酬的，可不受上述间隔期的限制，也不纳入间隔期考虑范围。

投资者在退出前如多次参与，则退出时对份额采取“先进先出”的原则进行计算，故存在投资者虽整体亏损，但是因部分份额有盈利，管理人仍然计提了业绩报酬的情况。另，因上述分红处理日计提业绩报酬的机制，如分红后退出确认或终止清算时份额累计净值低于或远低于分红处理日份额累计净值，亦存在投资者虽整体亏损，管理人仍然计提了业绩报酬的情况。

若本计划在分红时提取业绩报酬的，根据上述业绩报酬计算公式，业绩报酬从向投资者分配的分红资金中扣除且不超过分红资金，可能会存在投资者实际收到的现金分红款少于计划管理人披露的分配方案中载明的分红金额的情形。

同时根据上述业绩报酬的计提方式，本计划分红时，业绩报酬按分红时所有投资者所持计划份额累计净值增值部分计算，而非分红金额部分，故存在计提的业绩报酬占分红金额的比例不等于业绩报酬计提比例，甚至存在分红金额全为业绩报酬，导致虽分红但投资者实际未获得任何分红款的情况。

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支付的托管费。

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）	-