

中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年03月30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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2025年01月01日起至2025年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
8.3 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	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
8.6 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	66
8.7 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	66

8.8 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	66
8.9 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	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
8.12 投资组合报告附注	67
§ 9 基金份额持有人信息	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
9.3 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	68
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	68
§ 10 开放式基金份额变动	69
§ 11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
11.2 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	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4 基金投资策略的改变	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	71
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	72
12.1 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	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	中信建投睿利	
基金主代码	003308	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 07 日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	22,765,249.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C
下属分级基金的交易代码	003308	004635
报告期末下属分级基金的份额总额	5,774,345.39 份	16,990,904.24 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金融工具和债券等固定收益类金融工具，在有效控制风险的前提下，通过积极灵活的资产配置和组合精选，充分把握市场机会，力求实现基金资产的持续稳健增值。
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	中证 500 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
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，属于证券投资基金中中高预期风险、中高预期收益的品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟	郭明
	联系电话	010-59100208	010-66105799
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95588

传真	010-59100298	010-66105798
注册地址	北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100010	100140
法定代表人	黄凌	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年		2024 年		2023 年	
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C
本期已实现收益	5,477,348.85	5,723,840.36	3,127,066.49	2,157,574.11	-411,503.47	-160,317.27
本期利润	6,957,047.54	6,352,464.79	1,762,962.48	3,066,846.20	-140,250.66	240,403.55
加权平均基金份额本期利润	0.5078	0.4329	0.1095	0.1601	-0.0164	0.0109
本期加权平均净值利润率	38.66%	31.55%	11.40%	17.60%	-1.57%	1.08%
本期基金份额	46.22%	45.63%	7.94%	7.51%	-0.75%	-1.15%

额净值增长率						
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	3,461,792.03	9,155,750.20	1,556,246.38	501,504.05	109,405.33	-333,376.86
期末可供分配基金份额利润	0.5995	0.5389	0.0939	0.0567	0.0134	-0.0171
期末基金资产净值	9,236,137.42	26,146,654.44	18,134,891.78	9,353,314.43	8,277,066.44	19,177,880.65
期末基金份额净值	1.5995	1.5389	1.0939	1.0567	1.0134	0.9829
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	88.86%	81.93%	29.16%	24.93%	19.66%	16.20%

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、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果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（已实现部分相抵未实现部分）。

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

中信建投睿利 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	3.82%	0.95%	0.56%	0.74%	3.26%	0.21%
过去六个月	23.07%	0.96%	14.57%	0.70%	8.50%	0.26%
过去一年	46.22%	1.21%	17.10%	0.75%	29.12%	0.46%
过去三年	56.64%	1.35%	22.70%	0.75%	33.94%	0.60%
过去五年	27.39%	1.30%	4.66%	0.75%	22.73%	0.55%
自基金合同生效起至今	88.86%	1.13%	37.28%	0.73%	51.58%	0.40%

中信建投睿利 C 净值表现

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	3.71%	0.96%	0.56%	0.74%	3.15%	0.22%
过去六个月	22.82%	0.96%	14.57%	0.70%	8.25%	0.26%
过去一年	45.63%	1.21%	17.10%	0.75%	28.53%	0.46%
过去三年	54.77%	1.35%	22.70%	0.75%	32.07%	0.60%
过去五年	24.85%	1.30%	4.66%	0.75%	20.19%	0.55%
自基金合同生效起至今	81.93%	1.16%	38.62%	0.75%	43.31%	0.41%

注：根据基金管理人于 2024 年 6 月 7 日披露的《关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金变更业绩比较基准并修订基金合同和托管协议的公告》《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》，自 2024 年 6 月 7 日起，本基金的业绩比较基准由“60%×沪深 300 指数收益率+40%×中债综合指数收益率”变更为“中证 500 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%”。

3.2.2 自基金合同生效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

中信建投睿利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

(2016年12月07日-2025年12月31日)



中信建投睿利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

(2017年05月26日-2025年12月31日)



注：1、以上第 1 张图为中信建投睿利 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 2016 年 12 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日；

2、以上第 2 张图为中信建投睿利 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 2017 年 05 月 26 日（首笔份额登记日）至 2025 年 12 月 31 日；

3、根据基金管理人于 2024 年 06 月 07 日披露的《关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金变更业绩比较基准并修订基金合同和托管协议的公告》《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》，自 2024 年 06 月 07 日起，本基金的业绩比较基准由“60%×沪深 300 指数收益率+40%×中债综合指数收益率”变更为“中证 500 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%”。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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募集、销售、管理，特定客户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 68 个。

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	2023-03-17	-	13 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基

					金经理。
艾翀	本基金的基金经理	2024-02-06	-	8 年	中国籍，美国宾夕法尼亚州立大学数学博士。曾任北京首创期货有限责任公司金融创新部量化策略和期权分析师，北京派朗科技有限公司金融工程部金融工程师，国金基金管理有限公司指数投资部、量化投资三部基金经理助理、基金经理，北京创金启富基金销售有限公司基金投资研究部量化投资主管，恒安标准人寿保险有限公司投资部高级投资经理。2023 年 9 月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司指数与量化投资部基金经理，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》、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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中信建投基金管理有限公司公平交易管理办法》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事

后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。公司通过对不同时间窗口下的不同组合间股票和债券的同向交易进行价差分析，交易时机、交易价差和交易数量均可合理解释，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.3 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

2025 年中国经济 GDP 总量约 140 万亿元，增速 5%，全年发展更聚焦高质量导向，不再单纯追求增速规模。由于高基数和贸易保护主义等因素影响，全年进出口增速下降到 3.8%（前三季度累计进出口增速 4%）。其中第三产业增长 5.4%，贡献占比近 60%；高技术制造业增长 9.4%，新质生产力也发展迅速。全年进出口额实现稳定增长，增速 3.8%，其中出口增速 6.1%，进口增速 0.5%。分季度来看，出口稳中有进。其中显著的因素有：民营企业出口占比进一步提升到 57%；出口到“一带一路”国家的增速 6.3%，占比也达 52%；“新三样”出口增速 27%。2025 年全年 PMI 均值为 49.6，比 2024 年有所改善。分季度来看，一季度受政策推动逐月改善，整体较好。二三季度处于收缩区间，结构也有分化，生产端保持韧性，内外需求阶段性不足，服务业较强，制造业偏弱。四季度逐月走强，12 月超季节性地回升到荣枯线以上。总体来看，特征有生产强于需求、服务强于制造、大企业强于小企业。从全球来看，亚洲 PMI 最强，欧美最弱，中国在此之间。2025 年地产销售面积下降 8.7% 至 8.8 亿平方米，降幅较 2024 年收窄 4.2%；销售均价下降约 4%，其中二手房销售 7.37 亿平方米，成为销售主力。竣工面积 6 亿平方米，其中住宅竣工 4.28 亿平方米，较 2024 年下降 20%，明显收窄。地产开发投资 8.28 万亿元，降幅 17.2%，较 2024 年扩大 6.6%。其中办公楼降速 22.8%。地产政策进一步放松。2025 年消费稳中向好，社零全年达 50 万亿元，增长 3.7%，较 2024 年增速略有提升。最终消费支出占 GDP 增长贡献率 52%，较 2024 年提升 5%。消费结构持续优化，服务零售额增速 5.5%，快于商品零售额 1.7% 的增速。分季度来看，由于年初消费政策发力和基数影响，呈现前高后低的走势。全年网上零售额增长较快；体育娱乐用品、金银珠宝等新消费相关商品增长较快。全年 CPI 总体平稳，但结构分化。食品和能源价格持续走低，而核心 CPI 逐步回升，服务和非食品涨价。PPI 全年同比下降 2.6%，但反内卷政策在三季度成效显现，10 月起降幅连续收窄，12 月下降 1.9%，呈底部回升走势。2025 年全国基建投资下降 2.2%，为 2014 年以来首次负增长。固定资产投资整体下降 3.8%，反映出地方财政紧平衡、优质项目储备不足及城投债净融资受限等多重压力。但“两重”“两新”政策引领的设备置换和高技术产业投资增速较快，是基建亮点。另外，2025 年底集中批复了 4000 亿元重大项目，为“十五五”开局蓄力。

2025 年美国整体呈现“前低后高、再回落”的非对称增长态势，全年实际 GDP 增长 2.2%，虽低于 2024 年的 2.8%，但展现出较强韧性，尤其在第三季度实现强劲反弹，随后受政府停摆等因素拖累，四季度增速显著放缓。经济结构上，增长动力集中于消费与 AI 相关投资，但分配不均、政府支出波动和劳动力市场分化构成潜在风险。

A 股全年走出了结构性的“科技牛”行情。一季度在政策支持下走出了开门红，其中科技和小微盘表现较强；二季度尽管受到了特朗普税收政策的冲击，但 A 股经历波动后继续上行，风格回归均衡；三季度科技主线强化，市场全面爆发；四季度风格再平衡，风格偏向红利和防御。十年国债活跃券利率从年初 1.6% 低位震荡上行，3 月冲高至 1.9% 后回落，7 月前在 1.6%-1.7% 区间震荡，8 月起逐步回升，年末稳定在 1.85%。

报告期内依然坚持价值投资的理念，在复杂的经济环境与宏观事件冲击背景下，利用量化方法对各种风格与行业进行了均衡的配置，充分利用行业和个股的分散度，降低资产组合的波动，力争在行业与风格均衡配置的基础上，追求组合长期相对稳健的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投睿利 A 基金份额净值为 1.5995 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 46.22%，同期业绩比较基准收益率为 17.10%；截至报告期末中信建投睿利 C 基金份额净值为 1.5389 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 45.63%，同期业绩比较基准收益率为 17.10%。

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，作为“十五五”的起始年，政策支持应该会比较到位，经济基本面也可能是边际走强的。市场预期一、二季度 PPI 将延续上行态势；流动性层面，货币政策保持适度宽松，整体环境不会收紧。美联储在 6 月份或迎来新主席，其政策大概率更倾向于鸽派。全球流动性可能会出现阶段性波动，但从中期来看，政策将持续偏向鸽派。尽管 2026 年 3 月美以对伊朗发动军事行动，但考虑到特朗普政府的中期选举需求，全年来看，国际形势与贸易摩擦有望较 2025 年呈现阶段性缓和。新兴产业在过去几年里不仅有政策支持，而且科技水平和盈利水平都有长足进步，门类也在持续增加。人民币兑美元汇率也有可能继续偏强，权益可能以震荡上行为主，而有政策支持和有业绩支撑的新兴产业，以及受益于反内卷的偏上游行业、新型消费和服务消费等，在一季度都会有结构性机会和阶段性表现。

中美科技领域的竞争态势在 2026 年仍将延续，全球 AI 投资逻辑可能已经有了新的变化，国内投资受全球投资的影响会更加广泛和深入。而中国的高端制造业和科技产业将呈现多点开花的格局。监管部门在金融市场上展现出更加成熟稳健的治理能力，多项制度性政策协同发力，为 A 股市场稳中有进、长期健康发展奠定坚实基础。仍需注意，本轮行情中部分板块累计涨幅较大，叠加部分资金获利了结，市场波动可能加大。科技成长仍是主旋律，内需复苏尚待验证；在长线资金支撑下，红利与价值板块有望较 2025 年表现更佳。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人结合法律法规和业务发展需要，进一步修订、完善了公司内部制度；组织多项合规培训，加强员工的风险意识和合规意识；针对投资研究等重点业务，加大检查力度，促进公司业务合法合规、稳健经营；积极参与新产品、新业务的设计，提出合规建议，对基金宣传推介、基金投资交易等方面积极开展各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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、运营管理部门的部门负责人。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。

4.8 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。

4.9 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。

本基金本报告期内出现超过连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，基金管理人已向中国证监会报送了相关解决方案的报告。自 2024 年 5 月 28 日起，本基金迷你期间的审计费、信息披露费等相关固定费用由基金管理人固有资金承担。截至 2025 年 8 月 13 日，前述迷你情形已经消除。本基金自 2025 年 11 月 19 日起出现超过连续二十个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全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，本基金的管理人——中信建投基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，本基金托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对中信建投基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70069507_A11 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要</p>

	<p>求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>

	<p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊 朱燕
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2026-03-30

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	5,084,974.02	1,532,263.64
结算备付金		1,376,836.40	1,317,905.24
存出保证金		172,910.40	-
交易性金融资产	7.4.7.2	32,123,963.00	24,717,885.00
其中：股票投资		32,123,963.00	24,717,885.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		832,324.47	31,359.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		39,591,008.29	27,599,413.46
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,153,429.62	62,938.03
应付管理人报酬		39,260.21	29,711.50
应付托管费		6,543.37	4,951.90
应付销售服务费		8,901.87	3,495.94
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	81.36	10,109.88
负债合计		4,208,216.43	111,207.25
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	22,765,249.63	25,430,455.78
未分配利润	7.4.7.8	12,617,542.23	2,057,750.43
净资产合计		35,382,791.86	27,488,206.21
负债和净资产总计		39,591,008.29	27,599,413.46

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 22,765,249.63 份，其中中信建投睿利 A 类基金份额净值 1.5995 元，基金份额 5,774,345.39 份；中信建投睿利 C 类基金份额净值 1.5389 元，基金份额 16,990,904.24 份。

7.2 利润表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
-----	-----	---------------------------------------	--------------------------------------------

一、营业总收入		14,009,071.44	5,416,254.23
1. 利息收入		22,280.04	26,596.67
其中：存款利息收入	7.4.7.9	22,280.04	26,596.67
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）		11,734,573.85	5,841,373.21
其中：股票投资收益	7.4.7.10	10,335,953.87	4,909,195.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-479.47
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	998,702.79	477,250.26
股利收益	7.4.7.13	399,917.19	455,406.86
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	2,108,323.12	-454,831.92
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	143,894.43	3,116.27
减：二、营业总支出		699,559.11	586,445.55
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	456,687.33	400,880.09
2. 托管费	7.4.10.2.2	76,114.57	66,813.36
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	80,760.37	72,080.39
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		3,207.49	1,540.69
8. 其他费用	7.4.7.17	82,789.35	45,131.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,309,512.33	4,829,808.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,309,512.33	4,829,808.68
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,309,512.33	4,829,808.68

7.3 净资产变动表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日
----	---------------------------------------

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	25,430,455.78	2,057,750.43	27,488,206.21
二、本期期初净资产	25,430,455.78	2,057,750.43	27,488,206.21
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,665,206.15	10,559,791.80	7,894,585.65
(一)、综合收益总额	-	13,309,512.33	13,309,512.33
(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)	-2,665,206.15	-2,749,720.53	-5,414,926.68
其中: 1. 基金申购款	77,022,156.80	33,037,348.14	110,059,504.94
2. 基金赎回款	-79,687,362.95	-35,787,068.67	-115,474,431.62
(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	22,765,249.63	12,617,542.23	35,382,791.86
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	27,678,918.62	-223,971.53	27,454,947.09
二、本期期初净资产	27,678,918.62	-223,971.53	27,454,947.09
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,248,462.84	2,281,721.96	33,259.12
(一)、综合收益总额	-	4,829,808.68	4,829,808.68
(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)	-2,248,462.84	-2,548,086.72	-4,796,549.56
其中: 1. 基金申购款	48,398,826.64	-5,480,484.49	42,918,342.15
2. 基金赎回款	-50,647,289.48	2,932,397.77	-47,714,891.71
(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	25,430,455.78	2,057,750.43	27,488,206.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

黄凌

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可〔2016〕第 1962 号《关于准予中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准,由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和

国证券投资基金法》和《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具普华永道中天验字(2016)第 1356 号验资报告。经向中国证监会备案，《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 47,686,882.68 份基金份额，其中认购资金利息折合 19,936.07 份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金增加 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 2017 年 5 月 10 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《中信建投睿利灵活配置混合型发起式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)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0-95%；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合约需缴纳的交易保证金以后，现金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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

根据本基金管理人于 2024 年 6 月 7 日披露的《关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金变更业绩比较基准并修订基金合同和托管协议的公告》《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》，自 2024 年 6 月 7 日(含该日)起，本基金的业绩比较基准由“60%×沪深 300 指数收益率+40%×中债综合指数收益率”变更为“中证 500 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%”。

7.4.2 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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号<年度报告的内容与格式>》、《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>》、《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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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）”。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	3,375,202.21	364,329.98
等于：本金	3,375,051.89	364,304.91
加：应计利息	150.32	25.07
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	1,709,771.81	1,167,933.66
等于：本金	1,709,684.23	1,167,846.28
加：应计利息	87.58	87.38
减：坏账准备	-	-
合计	5,084,974.02	1,532,263.64

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	30,614,092.32	-	32,123,963.00	1,509,870.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-

	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		30,614,092.32	-	32,123,963.00	1,509,870.68
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票		25,327,337.44	-	24,717,885.00	-609,452.44
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		25,327,337.44	-	24,717,885.00	-609,452.44

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,451,920.00	-	-	-
股指期货	1,451,920.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,451,920.00	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动

IM2606	中证 1000 股指期货 2606 合约	1	1,440,920.00	-11,000.00
合计				-11,000.00
减：可抵销期货暂收款				-11,000.00
净额				0.00

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	81.36	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	-	10,109.88
合计	81.36	10,109.88

7.4.7.7 实收基金

中信建投睿利 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,578,645.40	16,578,645.40
本期申购	10,266,834.99	10,266,834.99
本期赎回（以“-”号填列）	-21,071,135.00	-21,071,135.00

本期末	5,774,345.39	5,774,345.39
-----	--------------	--------------

中信建投睿利 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,851,810.38	8,851,810.38
本期申购	66,755,321.81	66,755,321.81
本期赎回（以“-”号填列）	-58,616,227.95	-58,616,227.95
本期末	16,990,904.24	16,990,904.24

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）。

7.4.7.8 未分配利润

中信建投睿利 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	5,046,934.55	-3,490,688.17	1,556,246.38
本期期初	5,046,934.55	-3,490,688.17	1,556,246.38
本期利润	5,477,348.85	1,479,698.69	6,957,047.54
本期基金份额交易产生的变动数	-6,554,403.40	1,502,901.51	-5,051,501.89
其中：基金申购款	5,575,077.92	-1,185,581.18	4,389,496.74
基金赎回款	-12,129,481.32	2,688,482.69	-9,440,998.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,969,880.00	-508,087.97	3,461,792.03

中信建投睿利 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	2,340,745.91	-1,839,241.86	501,504.05
本期期初	2,340,745.91	-1,839,241.86	501,504.05
本期利润	5,723,840.36	628,624.43	6,352,464.79
本期基金份额交易产生的变动数	2,613,839.33	-312,057.97	2,301,781.36
其中：基金申购款	35,866,882.61	-7,219,031.21	28,647,851.40
基金	-33,253,043.28	6,906,973.24	-26,346,070.04

金赎回款			
本期已分 配利润	-	-	-
本期末	10,678,425.60	-1,522,675.40	9,155,750.20

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	3,494.25	1,802.58
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	6,721.97	9,550.42
结算备付金利息收入	12,063.82	15,080.95
其他	-	162.72
合计	22,280.04	26,596.67

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	569,236,595.61	620,264,623.11
减：卖出股票成本总额	558,043,487.54	614,364,157.08
减：交易费用	857,154.20	991,270.47
买卖股票差价收入	10,335,953.87	4,909,195.56

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	-	17.28
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	-496.75
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	-	-479.47

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	8,112.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	8,600.00
减：应计利息总额	-	9.33
减：交易费用	-	0.32
买卖债券差价收入	-	-496.75

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
期货投资	998,702.79	477,250.26

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	399,917.19	455,406.86
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	399,917.19	455,406.86

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	2,119,323.12	-454,831.92
——股票投资	2,119,323.12	-454,045.36
——债券投资	-	-786.56
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-11,000.00	-

——权证投资	-	-
——期货投资	-11,000.00	-
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	2,108,323.12	-454,831.92

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	142,415.22	3,116.27
转换费收入	1,479.21	-
合计	143,894.43	3,116.27

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%。

7.4.7.16 信用减值损失

无。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	-	10,109.88
信息披露费	80,000.00	11,202.02
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	2,389.35	2,119.12
证券账户开户费	400.00	-
其他费用	-	700.00
账户维护费	-	21,000.00
合计	82,789.35	45,131.02

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信建投利信资本管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 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	1,132,565,818.03	100.00%	1,234,251,461.95	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 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	-	-	8,112.90	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比	期末应付	占期末应付佣金总额的

		例	佣金余额	比例
中信建投证券股份有限公司	497,745.37	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 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	601,948.38	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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	456,687.33	400,880.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	168,640.57	130,855.25
应支付基金管理人的净管理费	288,046.76	270,024.84

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 1.20% 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 × 1.20% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	76,114.57	66,813.36

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	9,486.85	9,486.85
中信建投证券股份有限公司	-	28,690.80	28,690.80
中国工商银行股份有限公司	-	436.16	436.16
合计	-	38,613.81	38,613.81
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	18,036.49	18,036.49
中信建投证券股份有限公司	-	50,907.54	50,907.54
中国工商银行股份有限公司	-	53.97	53.97
合计	-	68,998.00	68,998.00

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提，逐日累计至每月月末，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。其计算公式为：

C 类基金日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中信建投睿利 A

份额单位：份

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2016 年 12 月 07 日）持有的基金份额	-	10,000,800.00
报告期初持有的基金份额	2,000,800.00	2,000,800.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	2,000,800.00	-
报告期末持有的基金份额	-	2,000,800.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	12.0685%

中信建投睿利 C

份额单位：份

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
报告期初持有的基金份额	2,124,269.78	2,124,269.78
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	2,124,269.78	-
报告期末持有的基金份额	-	2,124,269.78
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	23.9981%

7.4.10.4.2 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

中信建投睿利 C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信建投利信资本管理（北京）有限公司	-	-	892,618.05	10.0840%

7.4.10.5 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司-托管户	3,375,202.21	3,494.25	364,329.98	1,802.58
中信建投证券股份有限公司-证券户	1,690,788.17	6,717.91	1,167,933.66	9,550.42

注：本基金托管账户的存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。本基金证券资金账户的存款由中信建投证券股份有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金固定费用为其他费用项目中“审计费用”等费用。自 2025 年 1 月 2 日起至 2025 年 8 月 12 日，本基金的固定费用由本基金管理人承担，共计人民币 12,273.97 元。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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，将风险控制可在承受的范围之内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无余额。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

7.4.13.3 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 7.4.12.3 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同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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12（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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	5,084,974.02	-	-	-	5,084,974.02
结算备付金	1,376,836.40	-	-	-	1,376,836.40
存出保证金	-	-	-	172,910.40	172,910.40

交易性金融资产	-	-	-	32,123,963.00	32,123,963.00
应收申购款	-	-	-	832,324.47	832,324.47
资产总计	6,461,810.42	-	-	33,129,197.87	39,591,008.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,153,429.62	4,153,429.62
应付管理人报酬	-	-	-	39,260.21	39,260.21
应付托管费	-	-	-	6,543.37	6,543.37
应付销售服务费	-	-	-	8,901.87	8,901.87
其他负债	-	-	-	81.36	81.36
负债总计	-	-	-	4,208,216.43	4,208,216.43
利率敏感度缺口	6,461,810.42	-	-	28,920,981.44	35,382,791.86
上年度末 2024 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	1,532,263.64	-	-	-	1,532,263.64
结算备付金	1,317,905.24	-	-	-	1,317,905.24
交易性金融资产	-	-	-	24,717,885.00	24,717,885.00
应收申购款	-	-	-	31,359.58	31,359.58
资产总计	2,850,168.88	-	-	24,749,244.58	27,599,413.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	62,938.03	62,938.03
应付管理人报酬	-	-	-	29,711.50	29,711.50
应付托管费	-	-	-	4,951.90	4,951.90
应付销售服务费	-	-	-	3,495.94	3,495.94
其他负债	-	-	-	10,109.88	10,109.88
负债总计	-	-	-	111,207.25	111,207.25
利率敏感度缺口	2,850,168.88	-	-	24,638,037.33	27,488,206.21

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末及上年度末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例并不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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币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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	32,123,963.00	90.79	24,717,885.00	89.92
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	32,123,963.00	90.79	24,717,885.00	89.92

7.4.13.4.3.2 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	2,658,204.90	2,321,168.57
	业绩比较基准下降 5%	-2,658,204.90	-2,321,168.57

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	32,123,963.00	24,703,805.00
第二层次	-	14,080.00
第三层次	-	-
合计	32,123,963.00	24,717,885.00

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 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。

7.4.15.2 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。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	32,123,963.00	81.14
	其中：股票	32,123,963.00	81.14
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	6,461,810.42	16.32
8	其他各项资产	1,005,234.87	2.54
9	合计	39,591,008.29	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	131,580.00	0.37
B	采矿业	765,898.00	2.16
C	制造业	26,130,890.00	73.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	612,374.00	1.73
E	建筑业	44,408.00	0.13
F	批发和零售业	485,122.00	1.37
G	交通运输、仓储和邮政业	674,284.00	1.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,761,680.00	4.98
J	金融业	230,802.00	0.65
K	房地产业	76,894.00	0.22
L	租赁和商务服务业	317,969.00	0.90
M	科学研究和技术服务业	338,023.00	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	290,591.00	0.82
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	229,803.00	0.65
S	综合	33,645.00	0.10
	合计	32,123,963.00	90.79

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

8.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002916	深南电路	900	209,061.00	0.59
2	601138	工业富联	3,200	198,560.00	0.56
3	600183	生益科技	2,700	192,807.00	0.54
4	688025	杰普特	1,300	184,041.00	0.52
5	300308	中际旭创	300	183,000.00	0.52
6	688002	睿创微纳	1,800	181,440.00	0.51
7	300790	宇瞳光学	6,000	179,460.00	0.51
8	002258	利尔化学	12,700	165,735.00	0.47
9	002284	亚太股份	11,000	164,230.00	0.46
10	002182	宝武镁业	10,500	160,650.00	0.45
11	601609	金田股份	14,800	159,840.00	0.45
12	300054	鼎龙股份	4,200	157,920.00	0.45
13	688386	泛亚微透	1,800	157,680.00	0.45
14	002993	奥海科技	3,600	157,356.00	0.44
15	603588	高能环境	20,300	156,716.00	0.44
16	688508	芯朋微	2,500	152,250.00	0.43
17	002996	顺博合金	19,600	148,176.00	0.42
18	000554	泰山石油	22,700	147,096.00	0.42
19	600195	中牧股份	18,200	143,234.00	0.40
20	000600	建投能源	16,600	141,598.00	0.40
21	002056	横店东磁	7,100	138,450.00	0.39
22	002170	芭田股份	11,200	136,416.00	0.39
23	300154	瑞凌股份	13,700	134,945.00	0.38
24	688200	华峰测控	700	133,140.00	0.38
25	600075	新疆天业	26,800	132,660.00	0.37
26	300373	扬杰科技	1,900	129,200.00	0.37
27	600111	北方稀土	2,800	129,136.00	0.36
28	000708	中信特钢	7,800	127,686.00	0.36
29	603967	中创物流	9,100	124,943.00	0.35
30	002463	沪电股份	1,700	124,219.00	0.35
31	688328	深科达	4,200	122,556.00	0.35
32	600496	精工钢构	28,700	119,105.00	0.34
33	603611	诺力股份	4,800	117,360.00	0.33
34	002483	润邦股份	16,200	115,668.00	0.33

35	605020	永和股份	4,300	115,627.00	0.33
36	002441	众业达	12,300	115,620.00	0.33
37	600863	内蒙华电	25,800	115,584.00	0.33
38	600742	XD 富维股	11,500	115,000.00	0.33
39	002532	天山铝业	7,100	114,878.00	0.32
40	300916	朗特智能	3,500	114,730.00	0.32
41	300791	仙乐健康	4,400	113,784.00	0.32
42	603733	仙鹤股份	4,700	113,599.00	0.32
43	603486	科沃斯	1,400	112,952.00	0.32
44	603039	泛微网络	2,100	112,434.00	0.32
45	300196	长海股份	7,700	112,112.00	0.32
46	688686	奥普特	900	111,717.00	0.32
47	603950	长源东谷	3,800	110,010.00	0.31
48	002233	塔牌集团	12,200	109,922.00	0.31
49	002935	天奥电子	4,900	109,515.00	0.31
50	002135	东南网架	23,900	108,506.00	0.31
51	603638	艾迪精密	5,600	106,008.00	0.30
52	600392	盛和资源	4,900	105,497.00	0.30
53	600118	中国卫星	1,100	104,445.00	0.30
54	600114	东睦股份	3,400	103,870.00	0.29
55	002487	大金重工	2,000	103,860.00	0.29
56	600549	厦门钨业	2,500	102,650.00	0.29
57	300274	阳光电源	600	102,624.00	0.29
58	300976	达瑞电子	1,700	102,119.00	0.29
59	601600	中国铝业	8,300	101,426.00	0.29
60	300458	全志科技	2,400	100,872.00	0.29
61	301387	光大同创	1,800	99,720.00	0.28
62	688321	微芯生物	3,400	99,348.00	0.28
63	000589	贵州轮胎	19,100	98,938.00	0.28
64	688595	芯海科技	3,000	98,400.00	0.28
65	601369	陕鼓动力	9,800	98,098.00	0.28
66	600372	中航机载	7,300	97,966.00	0.28
67	688183	生益电子	1,000	95,690.00	0.27
68	603236	移远通信	1,000	95,410.00	0.27
69	002117	东港股份	6,900	95,289.00	0.27
70	002558	巨人网络	2,200	95,238.00	0.27
71	300488	恒锋工具	2,900	94,656.00	0.27
72	603328	依顿电子	8,600	94,256.00	0.27
73	688630	芯碁微装	700	94,171.00	0.27
74	002396	星网锐捷	3,100	93,930.00	0.27
75	601156	东航物流	5,100	93,891.00	0.27
76	603048	浙江黎明	4,400	93,016.00	0.26
77	300136	信维通信	1,500	93,000.00	0.26

78	600295	鄂尔多斯	7,500	92,700.00	0.26
79	301022	海泰科	2,800	92,652.00	0.26
80	600507	方大特钢	15,700	92,473.00	0.26
81	603238	诺邦股份	5,200	91,624.00	0.26
82	605058	澳弘电子	3,000	91,560.00	0.26
83	000576	甘化科工	8,600	90,558.00	0.26
84	688772	珠海冠宇	4,200	90,426.00	0.26
85	688678	福立旺	3,700	89,466.00	0.25
86	603713	密尔克卫	1,600	89,232.00	0.25
87	300219	鸿利智汇	12,300	88,683.00	0.25
88	000050	深天马A	9,700	87,591.00	0.25
89	002440	闰土股份	11,600	86,652.00	0.24
90	600489	中金黄金	3,700	86,432.00	0.24
91	300502	新易盛	200	86,176.00	0.24
92	600323	瀚蓝环境	3,000	85,800.00	0.24
93	300777	中简科技	2,100	85,680.00	0.24
94	301328	维峰电子	1,800	85,626.00	0.24
95	000895	双汇发展	3,200	84,704.00	0.24
96	603538	美诺华	4,400	84,656.00	0.24
97	000408	藏格矿业	1,000	84,400.00	0.24
98	603129	春风动力	300	83,604.00	0.24
99	300850	新强联	2,000	82,740.00	0.23
100	002937	兴瑞科技	3,500	82,600.00	0.23
101	688187	时代电气	1,600	82,064.00	0.23
102	600552	凯盛科技	6,600	81,840.00	0.23
103	300689	澄天伟业	1,800	80,910.00	0.23
104	688519	南亚新材	1,000	80,860.00	0.23
105	002297	博云新材	6,700	80,199.00	0.23
106	301280	珠城科技	1,500	79,890.00	0.23
107	002768	国恩股份	1,500	79,020.00	0.22
108	688257	新锐股份	2,300	78,844.00	0.22
109	600219	南山铝业	14,600	78,548.00	0.22
110	300743	天地数码	3,500	78,120.00	0.22
111	002001	新和成	3,100	78,089.00	0.22
112	688007	光峰科技	4,200	77,994.00	0.22
113	600288	大恒科技	5,200	77,896.00	0.22
114	688388	嘉元科技	1,900	77,862.00	0.22
115	688045	必易微	2,000	77,380.00	0.22
116	300353	东土科技	3,800	77,368.00	0.22
117	688584	上海合晶	3,500	76,790.00	0.22
118	688138	清溢光电	2,700	76,032.00	0.21
119	002338	奥普光电	1,300	75,907.00	0.21
120	300088	长信科技	12,500	75,750.00	0.21

121	605183	确成股份	3,800	75,696.00	0.21
122	300232	洲明科技	10,600	75,154.00	0.21
123	002452	长高电新	9,100	74,893.00	0.21
124	301528	多浦乐	1,100	74,800.00	0.21
125	600125	铁龙物流	11,600	74,704.00	0.21
126	002415	海康威视	2,500	74,600.00	0.21
127	601163	三角轮胎	5,200	74,308.00	0.21
128	688179	阿拉丁	5,900	73,691.00	0.21
129	605168	三人行	1,900	73,302.00	0.21
130	300602	飞荣达	2,200	72,952.00	0.21
131	603380	易德龙	1,900	72,200.00	0.20
132	688097	博众精工	1,900	71,725.00	0.20
133	600973	宝胜股份	9,800	71,540.00	0.20
134	600757	长江传媒	8,000	71,040.00	0.20
135	688313	仕佳光子	800	71,024.00	0.20
136	600435	北方导航	4,600	70,932.00	0.20
137	002714	牧原股份	1,400	70,812.00	0.20
138	600057	厦门象屿	8,300	70,716.00	0.20
139	000811	冰轮环境	3,800	70,376.00	0.20
140	002649	博彦科技	5,300	69,907.00	0.20
141	603969	银龙股份	6,900	69,759.00	0.20
142	600236	桂冠电力	8,900	69,687.00	0.20
143	688690	纳微科技	2,700	69,687.00	0.20
144	000657	中钨高新	2,500	69,275.00	0.20
145	600309	万华化学	900	69,012.00	0.20
146	605338	巴比食品	2,200	68,904.00	0.19
147	603739	蔚蓝生物	4,800	67,920.00	0.19
148	002824	和胜股份	3,500	67,900.00	0.19
149	301199	迈赫股份	2,900	67,628.00	0.19
150	300596	利安隆	1,600	67,536.00	0.19
151	301031	中熔电气	600	67,314.00	0.19
152	300953	震裕科技	400	67,208.00	0.19
153	601898	中煤能源	5,400	67,176.00	0.19
154	002465	海格通信	4,200	66,150.00	0.19
155	301330	熵基科技	2,000	66,100.00	0.19
156	688072	拓荆科技	200	66,000.00	0.19
157	688310	迈得医疗	4,300	65,919.00	0.19
158	600699	均胜电子	2,100	65,856.00	0.19
159	301589	诺瓦星云	400	65,820.00	0.19
160	002657	中科金财	2,200	65,692.00	0.19
161	601857	中国石油	6,300	65,583.00	0.19
162	600967	内蒙一机	3,900	65,520.00	0.19
163	603309	维力医疗	4,800	65,232.00	0.18

164	688655	迅捷兴	3,800	65,094.00	0.18
165	688677	海泰新光	1,500	64,740.00	0.18
166	601101	昊华能源	9,000	64,440.00	0.18
167	300033	同花顺	200	64,436.00	0.18
168	002552	宝鼎科技	3,900	64,389.00	0.18
169	688498	源杰科技	100	64,199.00	0.18
170	601168	西部矿业	2,300	63,572.00	0.18
171	301571	国科天成	1,100	63,448.00	0.18
172	603211	晋拓股份	2,800	63,140.00	0.18
173	600312	平高电气	3,600	62,460.00	0.18
174	000807	云铝股份	1,900	62,396.00	0.18
175	688708	佳驰科技	1,000	62,250.00	0.18
176	603203	快克智能	1,700	62,237.00	0.18
177	002028	思源电气	400	61,836.00	0.17
178	688610	埃科光电	1,000	61,810.00	0.17
179	300604	长川科技	600	60,786.00	0.17
180	300498	温氏股份	3,600	60,768.00	0.17
181	603585	苏利股份	3,200	60,352.00	0.17
182	300972	万辰集团	300	60,321.00	0.17
183	600021	上海电力	3,000	60,060.00	0.17
184	603993	洛阳钼业	3,000	60,000.00	0.17
185	688636	智明达	1,400	59,976.00	0.17
186	605228	神通科技	4,000	59,720.00	0.17
187	603218	日月股份	4,500	59,625.00	0.17
188	601019	山东出版	6,900	59,616.00	0.17
189	301208	中亦科技	1,500	59,520.00	0.17
190	000915	华特达因	1,800	59,472.00	0.17
191	002152	广电运通	4,300	59,383.00	0.17
192	688281	华秦科技	800	59,040.00	0.17
193	601717	中创智领	2,400	58,920.00	0.17
194	600801	华新建材	2,400	58,896.00	0.17
195	688208	道通科技	1,600	58,880.00	0.17
196	300620	光库科技	400	58,820.00	0.17
197	000683	博源化工	7,900	58,776.00	0.17
198	002096	易普力	4,400	58,608.00	0.17
199	600266	城建发展	11,500	58,305.00	0.16
200	301233	盛帮股份	1,100	58,212.00	0.16
201	000030	富奥股份	10,100	57,974.00	0.16
202	688084	晶品特装	700	57,960.00	0.16
203	002446	盛路通信	5,500	57,695.00	0.16
204	688131	皓元医药	800	57,664.00	0.16
205	688017	绿的谐波	300	57,630.00	0.16
206	300454	深信服	500	57,580.00	0.16

207	603282	亚光股份	2,900	57,536.00	0.16
208	300476	胜宏科技	200	57,516.00	0.16
209	688586	江航装备	4,400	57,376.00	0.16
210	605599	莱百股份	3,500	57,295.00	0.16
211	002386	天原股份	10,500	57,015.00	0.16
212	688308	欧科亿	1,800	56,952.00	0.16
213	300548	长芯博创	400	56,800.00	0.16
214	301132	满坤科技	1,700	56,610.00	0.16
215	300550	和仁科技	3,900	56,589.00	0.16
216	002079	苏州固锔	5,900	56,345.00	0.16
217	603787	新日股份	4,000	56,240.00	0.16
218	000561	烽火电子	4,600	56,212.00	0.16
219	605016	百龙创园	2,600	56,160.00	0.16
220	603682	锦和商管	8,500	56,015.00	0.16
221	301353	普莱得	2,100	55,860.00	0.16
222	688333	铂力特	500	55,755.00	0.16
223	688410	山外山	3,700	55,389.00	0.16
224	300644	南京聚隆	1,500	55,365.00	0.16
225	302132	中航成飞	700	55,300.00	0.16
226	603015	弘讯科技	4,400	55,220.00	0.16
227	300921	南凌科技	2,400	55,128.00	0.16
228	000338	潍柴动力	3,200	55,040.00	0.16
229	003025	思进智能	3,800	54,606.00	0.15
230	300748	金力永磁	1,600	54,576.00	0.15
231	300824	北鼎股份	4,800	54,288.00	0.15
232	603115	海星股份	2,900	54,259.00	0.15
233	002587	奥拓电子	8,000	54,080.00	0.15
234	000026	飞亚达	3,300	54,054.00	0.15
235	301509	金凯生科	1,600	54,048.00	0.15
236	301080	百普赛斯	1,000	54,000.00	0.15
237	301087	可孚医疗	1,200	53,604.00	0.15
238	301555	惠柏新材	1,600	53,488.00	0.15
239	600096	云天化	1,600	53,456.00	0.15
240	002408	齐翔腾达	10,900	53,192.00	0.15
241	000830	鲁西化工	3,200	53,024.00	0.15
242	002838	道恩股份	2,200	52,976.00	0.15
243	603009	北特科技	1,100	52,976.00	0.15
244	600590	泰豪科技	5,600	52,696.00	0.15
245	605198	安德利	1,400	52,668.00	0.15
246	603297	永新光学	500	52,650.00	0.15
247	688049	炬芯科技	1,000	52,600.00	0.15
248	002438	江苏神通	3,300	52,470.00	0.15
249	300803	指南针	400	52,348.00	0.15

250	600602	云赛智联	2,800	52,332.00	0.15
251	601999	出版传媒	7,600	52,212.00	0.15
252	688122	西部超导	700	52,206.00	0.15
253	000933	神火股份	1,900	52,193.00	0.15
254	301157	华塑科技	1,000	52,020.00	0.15
255	600237	铜峰电子	5,800	51,968.00	0.15
256	603607	京华激光	1,900	51,870.00	0.15
257	603871	嘉友国际	3,700	51,615.00	0.15
258	603927	中科软	2,700	51,543.00	0.15
259	002884	凌霄泵业	2,900	51,301.00	0.14
260	600958	东方证券	4,700	51,230.00	0.14
261	300547	川环科技	1,300	51,220.00	0.14
262	002863	今飞凯达	8,700	51,069.00	0.14
263	003043	华亚智能	1,100	51,007.00	0.14
264	300984	金沃股份	600	50,928.00	0.14
265	002181	粤传媒	5,900	50,858.00	0.14
266	688552	航天南湖	1,400	50,848.00	0.14
267	300590	移为通信	4,000	50,720.00	0.14
268	600528	中铁工业	6,200	50,716.00	0.14
269	603125	常青科技	3,000	50,640.00	0.14
270	600980	北矿科技	2,200	50,556.00	0.14
271	002815	崇达技术	3,700	50,542.00	0.14
272	600760	中航沈飞	900	50,535.00	0.14
273	301138	华研精机	1,300	50,440.00	0.14
274	002043	兔宝宝	3,500	50,435.00	0.14
275	603701	德宏股份	2,500	50,400.00	0.14
276	300323	华灿光电	6,300	50,274.00	0.14
277	301312	智立方	1,000	49,970.00	0.14
278	600150	中国船舶	1,500	49,890.00	0.14
279	300206	理邦仪器	3,900	49,881.00	0.14
280	002859	洁美科技	1,800	49,680.00	0.14
281	603105	芯能科技	5,400	49,626.00	0.14
282	300566	激智科技	2,700	49,545.00	0.14
283	600794	保税科技	12,700	49,530.00	0.14
284	301308	江波龙	200	48,968.00	0.14
285	603489	八方股份	1,600	48,928.00	0.14
286	300304	云意电气	4,200	48,888.00	0.14
287	002511	中顺洁柔	5,700	48,792.00	0.14
288	600010	宝钢股份	20,500	48,790.00	0.14
289	000677	恒天海龙	11,100	48,729.00	0.14
290	603217	元利科技	1,900	48,678.00	0.14
291	300113	顺网科技	2,400	48,576.00	0.14
292	300375	鹏翎股份	9,200	48,392.00	0.14

293	601127	赛力斯	400	48,384.00	0.14
294	601918	新集能源	7,300	48,253.00	0.14
295	000792	盐湖股份	1,700	47,872.00	0.14
296	300696	爱乐达	1,500	47,865.00	0.14
297	600415	小商品城	3,000	47,850.00	0.14
298	300053	航宇微	2,500	47,550.00	0.13
299	001338	永顺泰	3,900	47,229.00	0.13
300	601900	南方传媒	3,500	46,935.00	0.13
301	002206	海利得	8,000	46,800.00	0.13
302	603699	纽威股份	900	46,773.00	0.13
303	688312	燕麦科技	1,400	46,452.00	0.13
304	688778	厦钨新能	600	46,422.00	0.13
305	002380	科远智慧	1,700	46,240.00	0.13
306	688612	威迈斯	1,400	46,158.00	0.13
307	601677	明泰铝业	3,100	45,849.00	0.13
308	920976	视声智能	1,700	45,832.00	0.13
309	301149	隆华新材	4,300	45,752.00	0.13
310	920089	禾昌聚合	2,300	45,632.00	0.13
311	000725	京东方A	10,800	45,468.00	0.13
312	003010	若羽臣	1,300	45,461.00	0.13
313	603989	艾华集团	2,700	45,306.00	0.13
314	300124	汇川技术	600	45,198.00	0.13
315	002345	潮宏基	3,600	45,000.00	0.13
316	600143	金发科技	2,300	44,942.00	0.13
317	688523	航天环宇	800	44,768.00	0.13
318	605259	绿田机械	2,000	44,760.00	0.13
319	002128	电投能源	1,600	44,656.00	0.13
320	002459	晶澳科技	3,900	44,655.00	0.13
321	603289	泰瑞机器	4,400	44,528.00	0.13
322	000923	河钢资源	2,100	44,457.00	0.13
323	603005	晶方科技	1,600	44,256.00	0.13
324	301580	爱迪特	1,000	44,200.00	0.12
325	920195	三祥科技	2,000	43,920.00	0.12
326	600352	浙江龙盛	4,100	43,706.00	0.12
327	688019	安集科技	200	43,584.00	0.12
328	920599	同力股份	2,100	43,533.00	0.12
329	603511	爱慕股份	2,800	43,372.00	0.12
330	002402	和而泰	1,100	43,032.00	0.12
331	920110	雷特科技	1,200	42,900.00	0.12
332	920099	瑞华技术	1,300	42,757.00	0.12
333	603444	吉比特	100	42,385.00	0.12
334	603507	振江股份	1,600	42,096.00	0.12
335	600019	宝钢股份	5,600	41,720.00	0.12

336	002324	普利特	2,600	41,574.00	0.12
337	688521	芯原股份	300	41,091.00	0.12
338	300416	苏试试验	2,300	41,032.00	0.12
339	600388	龙净环保	2,500	40,775.00	0.12
340	688188	柏楚电子	300	40,767.00	0.12
341	300782	卓胜微	500	40,740.00	0.12
342	601518	吉林高速	14,400	40,608.00	0.11
343	000899	赣能股份	4,100	40,590.00	0.11
344	688248	南网科技	900	40,266.00	0.11
345	600893	航发动力	1,000	40,030.00	0.11
346	002080	中材科技	1,100	39,974.00	0.11
347	688502	茂莱光学	100	39,905.00	0.11
348	300101	振芯科技	1,400	39,802.00	0.11
349	920106	林泰新材	500	39,350.00	0.11
350	003009	中天火箭	500	39,270.00	0.11
351	601958	金钼股份	2,500	38,950.00	0.11
352	601058	赛轮轮胎	2,400	38,832.00	0.11
353	688127	蓝特光学	1,000	38,490.00	0.11
354	601137	博威合金	1,800	38,466.00	0.11
355	600282	南钢股份	7,300	38,398.00	0.11
356	688123	聚辰股份	300	37,674.00	0.11
357	688259	创耀科技	900	37,620.00	0.11
358	002734	利民股份	2,300	36,662.00	0.10
359	002454	松芝股份	4,200	36,582.00	0.10
360	002928	华夏航空	3,300	36,465.00	0.10
361	688557	兰剑智能	1,000	36,430.00	0.10
362	688103	国力电子	600	36,354.00	0.10
363	601126	四方股份	1,200	36,096.00	0.10
364	603876	鼎胜新材	2,400	36,024.00	0.10
365	688023	安恒信息	700	35,987.00	0.10
366	920026	卓兆点胶	1,000	35,500.00	0.10
367	002539	云图控股	3,000	35,460.00	0.10
368	002179	中航光电	1,000	35,440.00	0.10
369	300098	高新兴	5,800	35,380.00	0.10
370	688082	盛美上海	200	35,210.00	0.10
371	002930	宏川智慧	3,100	34,503.00	0.10
372	603583	捷昌驱动	900	34,263.00	0.10
373	603799	华友钴业	500	34,130.00	0.10
374	688018	乐鑫科技	200	34,000.00	0.10
375	000630	铜陵有色	5,600	33,656.00	0.10
376	600673	东阳光	1,500	33,645.00	0.10
377	000893	亚钾国际	700	33,579.00	0.09
378	300003	乐普医疗	2,100	33,201.00	0.09

379	002895	川恒股份	900	32,994.00	0.09
380	603612	索通发展	1,400	32,900.00	0.09
381	300772	运达股份	1,700	32,402.00	0.09
382	600230	沧州大化	2,100	32,046.00	0.09
383	000426	兴业银锡	900	32,040.00	0.09
384	688536	思瑞浦	200	31,976.00	0.09
385	688728	格科微	2,100	31,374.00	0.09
386	688661	和林微纳	600	31,056.00	0.09
387	002690	美亚光电	1,500	30,855.00	0.09
388	688258	卓易信息	400	30,628.00	0.09
389	688080	映翰通	600	30,300.00	0.09
390	688629	华丰科技	300	30,018.00	0.08
391	601107	四川成渝	4,800	29,184.00	0.08
392	300067	安诺其	5,800	29,000.00	0.08
393	688192	迪哲医药	500	28,800.00	0.08
394	002664	信质集团	1,200	28,752.00	0.08
395	002967	广电计量	1,300	28,613.00	0.08
396	300357	我武生物	1,000	28,350.00	0.08
397	688158	优刻得	1,000	28,090.00	0.08
398	600141	兴发集团	800	27,664.00	0.08
399	688360	德马科技	1,300	27,638.00	0.08
400	001316	润贝航科	700	27,636.00	0.08
401	001319	铭科精技	1,000	27,470.00	0.08
402	002039	黔源电力	1,500	27,255.00	0.08
403	002276	万马股份	1,600	27,056.00	0.08
404	300747	锐科激光	1,000	27,030.00	0.08
405	688322	奥比中光	300	26,901.00	0.08
406	603083	剑桥科技	200	26,876.00	0.08
407	002687	乔治白	5,400	26,028.00	0.07
408	300639	凯普生物	4,800	25,824.00	0.07
409	600989	宝丰能源	1,300	25,519.00	0.07
410	600750	江中药业	1,100	25,487.00	0.07
411	000768	中航西飞	1,000	25,380.00	0.07
412	301059	金三江	2,000	25,200.00	0.07
413	600461	洪城环境	2,700	25,029.00	0.07
414	002498	汉缆股份	6,500	24,895.00	0.07
415	002600	领益智造	1,600	24,864.00	0.07
416	688668	鼎通科技	200	24,800.00	0.07
417	300079	数码视讯	4,600	24,794.00	0.07
418	688088	虹软科技	500	24,750.00	0.07
419	603816	顾家家居	800	24,592.00	0.07
420	301592	六九一二	200	24,440.00	0.07
421	000988	华工科技	300	23,799.00	0.07

422	300140	节能环保	3,500	23,695.00	0.07
423	688568	中科星图	400	23,600.00	0.07
424	600497	驰宏锌锗	3,200	23,392.00	0.07
425	920690	捷众科技	700	23,331.00	0.07
426	001286	陕西能源	2,500	23,275.00	0.07
427	300570	太辰光	200	23,110.00	0.07
428	605056	咸亨国际	1,400	23,100.00	0.07
429	688499	利元亨	400	23,088.00	0.07
430	688369	致远互联	900	22,887.00	0.06
431	688236	春立医疗	1,000	22,880.00	0.06
432	300681	英搏尔	900	22,554.00	0.06
433	600459	贵研铂业	1,200	22,332.00	0.06
434	300870	欧陆通	100	22,100.00	0.06
435	600366	宁波韵升	1,600	22,064.00	0.06
436	601100	恒立液压	200	21,982.00	0.06
437	002782	可立克	1,200	21,792.00	0.06
438	300672	国科微	200	21,524.00	0.06
439	601698	中国卫通	600	21,438.00	0.06
440	603986	兆易创新	100	21,425.00	0.06
441	300913	兆龙互连	400	21,052.00	0.06
442	600095	湘财股份	1,900	21,014.00	0.06
443	002281	光迅科技	300	20,985.00	0.06
444	002546	新联电子	3,000	20,970.00	0.06
445	600486	扬农化工	300	20,817.00	0.06
446	301631	壹连科技	200	20,710.00	0.06
447	688182	灿勤科技	700	20,664.00	0.06
448	601088	中国神华	500	20,250.00	0.06
449	688146	中船特气	500	20,200.00	0.06
450	300395	菲利华	200	20,060.00	0.06
451	002063	远光软件	3,300	20,031.00	0.06
452	688698	伟创电气	200	19,776.00	0.06
453	600456	宝钛股份	500	19,725.00	0.06
454	600993	马应龙	700	19,600.00	0.06
455	603920	世运电路	400	19,364.00	0.05
456	600012	皖通高速	1,300	19,266.00	0.05
457	000766	通化金马	700	19,243.00	0.05
458	300503	昊志机电	300	19,116.00	0.05
459	688213	思特威	200	19,018.00	0.05
460	300709	精研科技	400	18,864.00	0.05
461	688147	微导纳米	300	18,837.00	0.05
462	688510	航亚科技	700	18,830.00	0.05
463	601096	宏盛华源	4,500	18,675.00	0.05
464	688300	联瑞新材	300	18,627.00	0.05

465	600987	航民股份	2,700	18,603.00	0.05
466	601702	华峰铝业	900	18,423.00	0.05
467	300567	精测电子	200	18,240.00	0.05
468	688626	翔宇医疗	300	18,150.00	0.05
469	002588	史丹利	1,800	17,964.00	0.05
470	688039	当虹科技	400	17,900.00	0.05
471	002896	中大力德	200	17,872.00	0.05
472	603893	瑞芯微	100	17,828.00	0.05
473	605003	众望布艺	500	17,775.00	0.05
474	688003	天准科技	300	17,670.00	0.05
475	688099	晶晨股份	200	17,446.00	0.05
476	688418	震有科技	400	17,392.00	0.05
477	002913	奥士康	400	17,096.00	0.05
478	600460	士兰微	600	17,046.00	0.05
479	002384	东山精密	200	16,930.00	0.05
480	002222	福晶科技	300	16,902.00	0.05
481	002595	豪迈科技	200	16,902.00	0.05
482	300857	协创数据	100	16,868.00	0.05
483	603308	应流股份	400	16,700.00	0.05
484	002545	东方铁塔	900	16,605.00	0.05
485	688800	瑞可达	200	16,600.00	0.05
486	603063	禾望电气	500	16,535.00	0.05
487	000962	东方钨业	500	16,530.00	0.05
488	002643	万润股份	1,100	16,489.00	0.05
489	600362	江西铜业	300	16,476.00	0.05
490	603992	松霖科技	400	16,368.00	0.05
491	603499	翔港科技	800	16,352.00	0.05
492	300428	立中集团	700	16,345.00	0.05
493	600428	中远海特	2,300	16,330.00	0.05
494	688029	南微医学	200	16,312.00	0.05
495	002756	永兴材料	300	16,275.00	0.05
496	601208	东材科技	600	16,254.00	0.05
497	603766	隆鑫通用	1,000	16,110.00	0.05
498	600869	远东股份	2,000	16,100.00	0.05
499	600409	三友化工	2,600	16,094.00	0.05
500	300007	汉威科技	300	16,080.00	0.05
501	002428	云南锗业	500	15,875.00	0.04
502	688711	宏微科技	500	15,865.00	0.04
503	301119	正强股份	300	15,807.00	0.04
504	002850	科达利	100	15,786.00	0.04
505	001266	宏英智能	400	15,748.00	0.04
506	301000	肇民科技	400	15,748.00	0.04
507	000733	振华科技	300	15,723.00	0.04

508	600011	华能国际	2,100	15,666.00	0.04
509	600690	海尔智家	600	15,654.00	0.04
510	605389	长龄液压	200	15,600.00	0.04
511	600970	中材国际	1,500	15,585.00	0.04
512	600547	山东黄金	400	15,484.00	0.04
513	601689	拓普集团	200	15,436.00	0.04
514	688656	浩欧博	100	15,380.00	0.04
515	600301	华锡有色	400	15,344.00	0.04
516	688160	步科股份	100	15,250.00	0.04
517	603979	金诚信	200	15,230.00	0.04
518	300399	天利科技	600	15,210.00	0.04
519	603633	徕木股份	1,500	15,195.00	0.04
520	002938	鹏鼎控股	300	15,174.00	0.04
521	600796	钱江生化	2,500	15,150.00	0.04
522	000063	中兴通讯	400	15,136.00	0.04
523	002560	通达股份	1,500	15,120.00	0.04
524	601231	环旭电子	500	15,000.00	0.04
525	002339	积成电子	1,700	14,994.00	0.04
526	002971	和远气体	500	14,940.00	0.04
527	002489	浙江永强	3,900	14,937.00	0.04
528	002484	江海股份	500	14,850.00	0.04
529	002497	雅化集团	600	14,850.00	0.04
530	688226	威腾电气	400	14,840.00	0.04
531	002436	兴森科技	700	14,819.00	0.04
532	002155	湖南黄金	700	14,763.00	0.04
533	605128	上海沿浦	400	14,744.00	0.04
534	688385	复旦微电	200	14,740.00	0.04
535	603256	宏和科技	400	14,724.00	0.04
536	688598	金博股份	500	14,680.00	0.04
537	002625	光启技术	300	14,628.00	0.04
538	000060	中金岭南	2,500	14,625.00	0.04
539	603228	景旺电子	200	14,618.00	0.04
540	000415	渤海租赁	3,600	14,580.00	0.04
541	688518	联赢激光	600	14,574.00	0.04
542	600875	东方电气	600	14,568.00	0.04
543	600803	新奥股份	700	14,532.00	0.04
544	603728	鸣志电器	200	14,470.00	0.04
545	688559	海目星	300	14,418.00	0.04
546	603662	柯力传感	200	14,400.00	0.04
547	000878	云南铜业	700	14,357.00	0.04
548	600969	郴电国际	1,400	14,322.00	0.04
549	603200	上海洗霸	200	14,228.00	0.04
550	002472	双环传动	300	14,223.00	0.04

551	301360	荣旗科技	200	14,180.00	0.04
552	600862	中航高科	600	14,178.00	0.04
553	301026	浩通科技	500	14,170.00	0.04
554	601688	华泰证券	600	14,154.00	0.04
555	600595	中孚实业	1,800	14,130.00	0.04
556	600531	豫光金铅	1,200	14,100.00	0.04
557	603301	振德医疗	200	14,100.00	0.04
558	600269	赣粤高速	2,700	14,013.00	0.04
559	001283	豪鹏科技	200	14,000.00	0.04
560	600741	华域汽车	700	14,000.00	0.04
561	603667	五洲新春	200	13,996.00	0.04
562	300115	长盈精密	300	13,950.00	0.04
563	601336	新华保险	200	13,940.00	0.04
564	002203	海亮股份	1,100	13,926.00	0.04
565	301377	鼎泰高科	100	13,910.00	0.04
566	000737	北方铜业	900	13,851.00	0.04
567	601899	紫金矿业	400	13,788.00	0.04
568	601318	中国平安	200	13,680.00	0.04
569	603275	众辰科技	300	13,674.00	0.04
570	603889	新澳股份	1,700	13,515.00	0.04
571	600765	中航重机	700	13,412.00	0.04
572	603681	永冠新材	700	13,286.00	0.04
573	603298	杭叉集团	500	13,285.00	0.04
574	605365	立达信	500	13,230.00	0.04
575	600873	梅花生物	1,300	13,169.00	0.04
576	300014	亿纬锂能	200	13,152.00	0.04
577	600066	宇通客车	400	13,080.00	0.04
578	605318	法狮龙	200	13,034.00	0.04
579	688639	华恒生物	400	13,032.00	0.04
580	688126	沪硅产业	600	12,984.00	0.04
581	688191	智洋创新	400	12,872.00	0.04
582	000738	航发控制	600	12,786.00	0.04
583	300447	全信股份	700	12,656.00	0.04
584	002979	雷赛智能	300	12,621.00	0.04
585	002429	兆驰股份	1,700	12,614.00	0.04
586	603501	豪威集团	100	12,590.00	0.04
587	002777	久远银海	700	12,558.00	0.04
588	301368	丰立智能	200	12,534.00	0.04
589	600988	赤峰黄金	400	12,496.00	0.04
590	002527	新时达	700	12,418.00	0.04
591	003021	兆威机电	100	12,418.00	0.04
592	000603	盛达资源	400	12,384.00	0.04
593	688625	呈和科技	300	12,360.00	0.03

594	688087	英科再生	400	12,328.00	0.03
595	688981	中芯国际	100	12,283.00	0.03
596	688077	大地熊	400	12,220.00	0.03
597	000975	山金国际	500	12,165.00	0.03
598	603379	三美股份	200	12,144.00	0.03
599	603819	神力股份	1,000	12,140.00	0.03
600	300553	集智股份	300	12,117.00	0.03
601	002064	华峰化学	1,100	12,100.00	0.03
602	688155	先惠技术	200	12,090.00	0.03
603	601233	桐昆股份	700	12,047.00	0.03
604	002250	联化科技	900	12,042.00	0.03
605	603767	中马传动	500	12,025.00	0.03
606	300455	航天智装	400	12,016.00	0.03
607	300473	德尔股份	400	11,912.00	0.03
608	603666	亿嘉和	400	11,880.00	0.03
609	688165	埃夫特	500	11,880.00	0.03
610	301200	大族数控	100	11,877.00	0.03
611	002747	埃斯顿	500	11,850.00	0.03
612	688326	经纬恒润	100	11,750.00	0.03
613	301255	通力科技	400	11,700.00	0.03
614	603685	晨丰科技	600	11,694.00	0.03
615	688663	新风光	300	11,631.00	0.03
616	300161	华中数控	400	11,616.00	0.03
617	600966	博汇纸业	1,700	11,611.00	0.03
618	000887	中鼎股份	500	11,605.00	0.03
619	688787	海天瑞声	100	11,599.00	0.03
620	000837	秦川机床	900	11,592.00	0.03
621	002318	久立特材	400	11,580.00	0.03
622	300073	当升科技	200	11,560.00	0.03
623	300403	汉宇集团	800	11,528.00	0.03
624	600160	巨化股份	300	11,526.00	0.03
625	688525	佰维存储	100	11,479.00	0.03
626	600560	金自天正	700	11,438.00	0.03
627	601238	广汽集团	1,400	11,424.00	0.03
628	688218	江苏北人	500	11,410.00	0.03
629	002403	爱仕达	900	11,394.00	0.03
630	300756	金马游乐	200	11,376.00	0.03
631	002779	中坚科技	100	11,356.00	0.03
632	002475	立讯精密	200	11,342.00	0.03
633	600562	国睿科技	400	11,304.00	0.03
634	688392	骄成超声	100	11,220.00	0.03
635	688320	禾川科技	300	11,196.00	0.03
636	600577	精达股份	900	11,187.00	0.03

637	688219	会通股份	900	11,178.00	0.03
638	000960	锡业股份	400	11,152.00	0.03
639	300543	朗科智能	1,000	11,120.00	0.03
640	002167	东方锆业	900	11,115.00	0.03
641	002050	三花智控	200	11,062.00	0.03
642	300466	赛摩智能	1,100	11,055.00	0.03
643	002988	豪美新材	300	11,040.00	0.03
644	603738	泰晶科技	700	10,997.00	0.03
645	688255	凯尔达	300	10,989.00	0.03
646	300652	雷迪克	200	10,972.00	0.03
647	300660	江苏雷利	200	10,964.00	0.03
648	688567	孚能科技	700	10,955.00	0.03
649	300222	科大智能	1,000	10,940.00	0.03
650	002517	恺英网络	500	10,935.00	0.03
651	300024	机器人	600	10,914.00	0.03
652	000301	东方盛虹	1,000	10,890.00	0.03
653	600038	中直股份	300	10,839.00	0.03
654	002957	科瑞技术	500	10,825.00	0.03
655	300765	新诺威	300	10,821.00	0.03
656	688347	华虹公司	100	10,787.00	0.03
657	002892	科力尔	800	10,736.00	0.03
658	002837	英维克	100	10,689.00	0.03
659	605088	冠盛股份	300	10,680.00	0.03
660	688207	格灵深瞳	700	10,640.00	0.03
661	002801	微光股份	300	10,623.00	0.03
662	603663	三祥新材	300	10,605.00	0.03
663	300532	今天国际	900	10,602.00	0.03
664	688396	华润微	200	10,572.00	0.03
665	000678	襄阳轴承	700	10,521.00	0.03
666	300580	贝斯特	400	10,516.00	0.03
667	600316	洪都航空	300	10,473.00	0.03
668	002576	通达动力	600	10,440.00	0.03
669	600583	海油工程	1,900	10,431.00	0.03
670	920578	巨能股份	400	10,420.00	0.03
671	605123	派克新材	100	10,390.00	0.03
672	605287	德才股份	400	10,368.00	0.03
673	300843	胜蓝股份	200	10,312.00	0.03
674	301093	华兰股份	200	10,220.00	0.03
675	603568	伟明环保	400	10,152.00	0.03
676	688301	奕瑞科技	100	10,111.00	0.03
677	002230	科大讯飞	200	10,058.00	0.03
678	002158	汉钟精机	400	10,012.00	0.03
679	688819	天能股份	300	9,966.00	0.03

680	300607	拓斯达	300	9,882.00	0.03
681	688777	中控技术	200	9,868.00	0.03
682	002594	比亚迪	100	9,772.00	0.03
683	688577	浙海德曼	100	9,686.00	0.03
684	688013	天臣医疗	200	9,616.00	0.03
685	600618	氯碱化工	800	9,504.00	0.03
686	605566	福莱茵特	300	9,447.00	0.03
687	688091	上海谊众	200	9,400.00	0.03
688	600848	上海临港	800	9,360.00	0.03
689	301168	通灵股份	200	9,340.00	0.03
690	603878	武进不锈	1,000	9,260.00	0.03
691	002062	宏润建设	1,000	9,250.00	0.03
692	600510	黑牡丹	1,100	9,229.00	0.03
693	600846	同济科技	700	9,205.00	0.03
694	001306	夏厦精密	100	8,900.00	0.03
695	688234	天岳先进	100	8,888.00	0.03
696	605117	德业股份	100	8,620.00	0.02
697	603019	中科曙光	100	8,564.00	0.02
698	300718	长盛轴承	100	8,536.00	0.02
699	300257	开山股份	600	8,430.00	0.02
700	601069	西部黄金	300	8,004.00	0.02
701	000333	美的集团	100	7,815.00	0.02
702	300138	晨光生物	600	7,446.00	0.02
703	603306	华懋科技	100	6,301.00	0.02
704	300678	中科信息	200	6,152.00	0.02
705	600389	江山股份	200	5,056.00	0.01
706	002010	传化智联	800	4,648.00	0.01
707	603599	广信股份	400	4,592.00	0.01
708	300119	瑞普生物	200	3,754.00	0.01
709	600498	烽火通信	100	3,208.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	603309	维力医疗	1,161,520.00	4.23
2	000751	锌业股份	1,135,418.00	4.13
3	600742	富维股份	1,048,380.00	3.81
4	601678	滨化股份	1,043,428.00	3.80
5	688466	金科环境	1,007,852.17	3.67
6	688013	天臣医疗	947,789.98	3.45
7	603043	广州酒家	947,404.00	3.45

8	300532	今天国际	831,855.00	3.03
9	002451	摩恩电气	807,381.00	2.94
10	002399	海普瑞	805,741.00	2.93
11	688668	鼎通科技	803,071.45	2.92
12	603701	德宏股份	794,655.00	2.89
13	000030	富奥股份	780,071.00	2.84
14	600578	京能电力	772,447.00	2.81
15	002284	亚太股份	768,912.00	2.80
16	002777	久远银海	737,500.00	2.68
17	600519	贵州茅台	733,288.00	2.67
18	003025	思进智能	720,908.00	2.62
19	688183	生益电子	719,132.71	2.62
20	688308	欧科亿	716,159.26	2.61
21	600560	金自天正	705,566.00	2.57
22	300481	濮阳惠成	704,405.00	2.56
23	600662	外服控股	704,353.00	2.56
24	002344	海宁皮城	702,159.00	2.55
25	603187	海容冷链	701,934.12	2.55
26	603588	高能环境	692,535.00	2.52
27	600675	中华企业	692,026.00	2.52
28	601609	金田股份	690,765.00	2.51
29	688162	巨一科技	689,542.84	2.51
30	600997	开滦股份	689,247.00	2.51
31	603730	岱美股份	688,869.00	2.51
32	600020	中原高速	685,992.00	2.50
33	002498	汉缆股份	684,997.00	2.49
34	600496	精工钢构	679,928.00	2.47
35	600477	杭萧钢构	671,027.00	2.44
36	600739	辽宁成大	666,677.00	2.43
37	002101	广东鸿图	663,196.00	2.41
38	600867	通化东宝	656,452.00	2.39
39	600183	生益科技	654,592.40	2.38
40	600736	苏州高新	643,402.00	2.34
41	002233	塔牌集团	643,377.00	2.34
42	603216	梦天家居	641,250.00	2.33
43	300219	鸿利智汇	630,615.00	2.29
44	601311	骆驼股份	628,189.00	2.29
45	600055	万东医疗	626,725.00	2.28
46	601700	风范股份	624,184.00	2.27
47	688131	皓元医药	623,111.47	2.27
48	688618	三旺通信	621,941.50	2.26
49	300445	康斯特	621,763.00	2.26
50	603725	天安新材	617,390.00	2.25

51	600757	长江传媒	613,726.00	2.23
52	300206	理邦仪器	613,567.00	2.23
53	688007	光峰科技	612,641.65	2.23
54	603638	艾迪精密	612,301.00	2.23
55	002614	奥佳华	611,093.00	2.22
56	003031	中瓷电子	609,480.00	2.22
57	600335	国机汽车	599,809.00	2.18
58	300407	凯发电气	598,962.00	2.18
59	603601	再升科技	593,823.00	2.16
60	000708	中信特钢	581,502.00	2.12
61	688321	微芯生物	580,264.06	2.11
62	002396	星网锐捷	576,230.00	2.10
63	688315	诺禾致源	574,410.49	2.09
64	688526	科前生物	569,944.97	2.07
65	603890	春秋电子	568,449.00	2.07
66	601319	中国人保	568,400.00	2.07
67	301218	华是科技	568,102.00	2.07
68	600918	中泰证券	565,284.00	2.06
69	600057	厦门象屿	563,642.00	2.05
70	600866	星湖科技	562,388.00	2.05
71	000523	红棉股份	560,990.00	2.04
72	002662	峰璟股份	560,688.00	2.04
73	002216	三全食品	558,975.00	2.03
74	000686	东北证券	556,530.00	2.02
75	002976	瑞玛精密	552,557.00	2.01
76	600489	中金黄金	552,238.00	2.01
77	300308	中际旭创	549,788.00	2.00

8.4.2 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	000751	锌业股份	1,151,905.00	4.19
2	603309	维力医疗	1,129,688.00	4.11
3	688013	天臣医疗	1,122,720.15	4.08
4	601678	滨化股份	1,030,146.00	3.75
5	688466	金科环境	1,008,916.65	3.67
6	603043	广州酒家	960,000.00	3.49
7	600742	富维股份	950,496.00	3.46
8	002451	摩恩电气	919,470.00	3.34
9	002399	海普瑞	873,411.00	3.18
10	688668	鼎通科技	856,896.50	3.12
11	300532	今天国际	832,937.00	3.03

12	002777	久远银海	815,979.28	2.97
13	600578	京能电力	805,517.00	2.93
14	002498	汉缆股份	787,863.00	2.87
15	600496	精工钢构	763,207.00	2.78
16	000030	富奥股份	762,760.00	2.77
17	600997	开滦股份	753,662.00	2.74
18	603187	海容冷链	749,209.00	2.73
19	600519	贵州茅台	748,453.00	2.72
20	688183	生益电子	733,547.66	2.67
21	600477	杭萧钢构	729,039.00	2.65
22	603701	德宏股份	726,683.00	2.64
23	600662	外服控股	725,415.00	2.64
24	300481	濮阳惠成	719,754.00	2.62
25	002344	海宁皮城	713,894.00	2.60
26	688162	巨一科技	709,412.83	2.58
27	600560	金自天正	692,316.00	2.52
28	603601	再升科技	690,316.40	2.51
29	603216	梦天家居	689,214.00	2.51
30	600739	辽宁成大	688,940.00	2.51
31	688109	品茗科技	688,870.19	2.51
32	601311	骆驼股份	685,568.00	2.49
33	688308	欧科亿	684,940.92	2.49
34	603730	岱美股份	678,937.70	2.47
35	002101	广东鸿图	677,464.00	2.46
36	600675	中华企业	676,779.00	2.46
37	600020	中原高速	675,758.00	2.46
38	002478	常宝股份	675,070.00	2.46
39	603508	思维列控	674,104.00	2.45
40	003025	思进智能	668,526.00	2.43
41	600867	通化东宝	661,714.00	2.41
42	300445	康斯特	660,197.00	2.40
43	300770	新媒股份	653,046.00	2.38
44	601700	风范股份	648,094.00	2.36
45	600736	苏州高新	644,342.00	2.34
46	002284	亚太股份	641,201.00	2.33
47	603638	艾迪精密	627,407.00	2.28
48	688618	三旺通信	622,639.42	2.27
49	688007	光峰科技	617,557.73	2.25
50	688131	皓元医药	611,507.40	2.22
51	002614	奥佳华	608,290.00	2.21
52	000726	鲁泰A	608,116.00	2.21
53	003031	中瓷电子	608,012.60	2.21
54	002396	星网锐捷	607,844.00	2.21

55	601319	中国人保	607,057.00	2.21
56	600055	万东医疗	605,550.00	2.20
57	688315	诺禾致源	600,939.51	2.19
58	300219	鸿利智汇	600,094.00	2.18
59	600335	国机汽车	598,811.00	2.18
60	300407	凯发电气	597,180.00	2.17
61	600282	南钢股份	595,912.00	2.17
62	603725	天安新材	594,250.00	2.16
63	601811	新华文轩	593,530.00	2.16
64	688128	中国电研	589,552.94	2.14
65	002745	木林森	583,188.00	2.12
66	301218	华是科技	577,261.00	2.10
67	603588	高能环境	572,995.00	2.08
68	600966	博汇纸业	572,170.00	2.08
69	601609	金田股份	570,301.00	2.07
70	603890	春秋电子	567,663.00	2.07
71	600183	生益科技	566,841.70	2.06
72	000686	东北证券	565,336.00	2.06
73	002662	峰璟股份	564,489.00	2.05
74	300206	理邦仪器	562,563.00	2.05
75	002976	瑞玛精密	557,693.00	2.03
76	688201	信安世纪	556,808.80	2.03
77	002925	盈趣科技	556,376.00	2.02
78	600918	中泰证券	554,327.00	2.02

8.4.3 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	563,330,242.42
卖出股票收入（成交）总额	569,236,595.61

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

8.6 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

无余额。

8.7 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

无余额。

8.8 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

无余额。

8.9 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

无余额。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

8.12.3 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	172,910.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	832,324.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,005,234.87

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
中信建投睿利 A	810	7,128.82	0.00	0.0000%	5,774,345.39	100.0000%
中信建投睿利 C	3,020	5,626.13	192,737.42	1.1344%	16,798,166.82	98.8656%
合计	3,746	6,077.22	192,737.42	0.8466%	22,572,512.21	99.1534%

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。

9.2 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	中信建投睿利 A	81,090.21	1.4043%
	中信建投睿利 C	1,160.72	0.0068%
	合计	82,250.93	0.3613%

9.3 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	中信建投睿利 A	0~10
	中信建投睿利 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投睿利 A	0~10
	中信建投睿利 C	0
	合计	0~10

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

截至 2019 年 12 月 7 日，中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同生效届满

三年。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 07 日）基金份额总额	47,686,882.68	-
本报告期初基金份额总额	16,578,645.40	8,851,810.38
本报告期基金总申购份额	10,266,834.99	66,755,321.81
减：本报告期基金总赎回份额	21,071,135.00	58,616,227.95
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	5,774,345.39	16,990,904.24

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告期内本基金应支付审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 0.00 元整，其已提供审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人未因托管业务受调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员未受调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	3	1,132,565,818.03	100.00%	497,745.37	100.00%	-
东方证券股份有限公司	3	1,020.00	0.00%	0.36	0.00%	-

注：1、本基金的证券交易结算模式为券商结算模式，表中的证券交易成交金额及应支付的佣金等数据，为委托证券公司办理证券投资及佣金支付情况。

2、本报告期内，本基金新增办理证券投资委托的证券公司为东方证券股份有限公司。

3、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。

11.8 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全部基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-01-22
2	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	规定网站	2025-01-22
3	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（2024 年度）	规定网站	2025-03-31
4	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年年度报告提示性公告	规定报刊	2025-03-31
5	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	规定网站	2025-03-31
6	中信建投基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下权益类公募基金的公告	规定网站、规定报刊	2025-04-11
7	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-04-22
8	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	规定网站	2025-04-22
9	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-07-21
10	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	规定网站	2025-07-21
11	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年中期报告提示性公告	规定报刊	2025-08-29
12	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年中期报告	规定网站	2025-08-29
13	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金在交通银行股份有限公司开通基金转换业务	规定网站、规定报刊	2025-09-23

	的公告		
14	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-10-28
15	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	规定网站	2025-10-28
16	中信建投基金管理有限公司关于终止北京微动利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	2025-12-02
17	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	规定网站、规定报刊	2025-12-03
18	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	规定网站	2025-12-12
19	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2025-12-12
20	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2025-12-12

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20250418-20250514	4,125,069.78	0.00	4,125,069.78	0.00	0.0000%
	2	20250101-20250818	11,378,337.13	0.00	11,378,337.13	0.00	0.0000%
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。							

12.2 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投睿利灵活配置混合型发起式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。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 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

二〇二六年三月三十一日