

# 中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 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:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2023 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，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2023年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	12
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§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	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	81
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	82
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	82
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	82
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	82
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	82
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
7.12 投资组合报告附注	82
§8 基金份额持有人信息	83
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84

8.3	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 .....	84
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	84
§9	开放式基金份额变动 .....	85
§10	重大事件揭示 .....	85
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	85
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 .....	85
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	85
10.4	基金投资策略的改变 .....	86
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	86
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	86
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	86
10.8	其他重大事件 .....	88
§11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	90
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 .....	90
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	90
§12	备查文件目录 .....	90
12.1	备查文件目录 .....	90
12.2	存放地点 .....	91
12.3	查阅方式 .....	91

## §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	38,554,049.57份	
基金合同存续期	不定期	
下属各类别基金的基金简称	中信建投睿利A	中信建投睿利C
下属各类别基金的交易代码	003308	004635
报告期末下属各类别基金的份额总额	9,237,847.12份	29,316,202.45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	沪深300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2号凯恒中心B座17、19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	陈四清

### 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金中期报告备置地点	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
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2号凯恒中心B座17、19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 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	中信建投睿利A	中信建投睿利C
本期已实现收益	-161,055.16	45,916.17
本期利润	492,406.63	697,741.15
加权平均基金份额本期利润	0.0592	0.0412
本期加权平均净值利润率	5.50%	3.95%
本期基金份额净值增长率	5.90%	5.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	751,096.19	1,491,345.04
期末可供分配基金份额利润	0.0813	0.0509
期末基金资产净值	9,988,943.31	30,807,547.49
期末基金份额净值	1.0813	1.0509
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	27.68%	24.24%

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

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
过去一个月	1.20%	0.95%	0.78%	0.52%	0.42%	0.43%
过去三个月	0.47%	0.87%	-2.71%	0.49%	3.18%	0.38%
过去六个月	5.90%	0.84%	0.13%	0.50%	5.77%	0.34%
过去一年	-7.10%	1.08%	-8.10%	0.59%	1.00%	0.49%
过去三年	1.74%	1.11%	-2.34%	0.72%	4.08%	0.39%
自基金合同生效起至今	27.68%	0.98%	12.04%	0.71%	15.64%	0.27%

中信建投睿利C

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
过去一个月	1.17%	0.95%	0.78%	0.52%	0.39%	0.43%
过去三个月	0.37%	0.87%	-2.71%	0.49%	3.08%	0.38%
过去六个月	5.69%	0.84%	0.13%	0.50%	5.56%	0.34%
过去一年	-7.47%	1.08%	-8.10%	0.59%	0.63%	0.49%
过去三年	0.54%	1.11%	-2.34%	0.72%	2.88%	0.39%
自基金合同生效起至今	24.24%	1.02%	13.13%	0.73%	11.11%	0.29%

#### 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-2023年06月30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-2023年06月30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7日（基金合同生效日）至2023年6月30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5月26日（首笔份额登记日）至2023年6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基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，中信建投基金共管理50只公募证券投资基金。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。

中信建投基金作为资产管理公司，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	2023-03-17	-	11年	中国籍，1986年10月生，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

					司, 现任本公司权益投资一部基金经理, 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基金经理。
周户	本基金的基金经理	2017-01-25	2023-03-29	15年	中国籍, 1982年2月生, 南开大学经济学硕士。曾任苏州博思堂经纪顾问有限公司市场分析师、渤海证券股份有限公司研究员、广发证券股份有限公司研究员、国金通用基金管理有限公司研究员、国金证券股份有限公司研究员。2014年6月加入中信建投基金管理有限公司, 曾任投资研究部研究员, 现任本公司权益投资一部基金经理, 担任中信建投稳利混合型证券投资基金基金经理。2023年3月29日起, 因工作安排不再担任本基金基金经理。

注: 1、基金经理任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。首任基金经理, 任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 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销售机构监督管理办法》《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》《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, 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《证券投资基金管理人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不公平交易的情况。

### 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

报告期内，依然坚持价值投资的理念，采用自上而下的策略，通过对包括经济运行周期、财政及货币政策、产业政策等宏观经济基本面的分析判断，结合资金面供需情况、证券市场估值水平，借助数量化分析思路，对个股的波动进行评估，提升行业和个股的分散度，降低了资产组合的波动，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1.0813元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.90%，同期业绩比较基准收益率为0.13%；截至报告期末中信建投睿利C基金份额净值为1.0509元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.69%，同期业绩比较基准收益率为0.13%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年上半年，国内经济从衰退末期进入复苏阶段，一季度初，市场情绪性反弹叠加流动性宽松预期推动权益市场的快速上行，反弹初期以疫后困境反转的消费与房地产为主，伴随Open AI公司发布新一代的人工智能模型，TMT等高弹性板块逐渐占优，人工智能的大规模应用引发市场的关注，未来也的确可能引发新一轮的技术革命，带来潜在增长率的上升，但是短期来看，其在具体领域的应用场景与业绩兑现需要观察。部分行业高频数据在二季度开始走弱，市场对于经济修复韧性和速度的预期产生分歧，4月末的政治局会议表态总量政策不刺激的态度，进一步加速了利率的下行；6月中旬伴随中央推出降息政策，10年期国债利率创出了年内最低水平。中长期国债利率的下行验证了市场对于经济快速修复预期的修正，再叠加美联储仍未完全放弃加息，美债利率处于高位，中美利差对人民币也产生了被动的贬值压力。虽然复苏程度低于预期，但横向比

较，我国上半年GDP增速在全球主要经济体中位居前列，多项消费出行指标也恢复至2019年水平，但是国内权益市场表现在主要经济体中排名靠后：沪深300指数跌0.75%，振幅高达12.67%；创业板指数跌5.61%，振幅高达23.11%。

我们认为上半年权益市场或对国内经济前景的预期过于悲观，在流动性合理充裕的情况下，风险偏好下降导致资金主要流向低风险资产。展望下半年，考虑到A股整体估值处于近十几年的低点，悲观预期很可能伴随稳增长、促消费等方面政策落地而进行修复，尤其关注产业趋势较为强劲且有海外映射逻辑的AI产业链、受益于全球半导体周期的重启的半导体产业链、库存出清末期且受益于消费进一步复苏的家电、家具等地产后周期产业链。

#### 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、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。

#### 4.7 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，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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。

本基金自2021年5月27日起至2023年3月28日止连续447个工作日资产净值低于5000万元，管理人已经向中国证券监督管理委员会报送了报告。自2023年4月12日起至2023年6月30日止连续53个工作日资产净值低于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，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2023年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,643,124.60	570,830.95
结算备付金		289,425.63	15,277.99
存出保证金		18,743.25	1,480.94
交易性金融资产	6.4.7.2	31,020,534.79	9,019,239.30

其中：股票投资		30,807,374.59	7,685,756.81
基金投资		-	-
债券投资		213,160.20	1,333,482.49
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	-34.03	500,227.82
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	750,709.61
应收股利		-	-
应收申购款		7,029,218.87	2,142.25
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		41,001,013.11	10,859,908.86
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	9,465.74
应付赎回款		8,135.17	2,033.35
应付管理人报酬		36,662.25	13,935.98

应付托管费		6,110.41	2,322.64
应付销售服务费		6,790.38	1,154.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	218.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	146,824.10	45,372.26
负债合计		204,522.31	74,503.60
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.6	38,554,049.57	10,650,901.46
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	2,242,441.23	134,503.80
净资产合计		40,796,490.80	10,785,405.26
负债和净资产总计		41,001,013.11	10,859,908.86

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额总额38,554,049.57份。其中A类基金份额净值1.0813元，基金份额9,237,847.12份；C类基金份额净值1.0509元，基金份额29,316,202.45份。

## 6.2 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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		1,494,895.55	-858,096.92
1.利息收入		13,078.84	1,737.16
其中：存款利息收入	6.4.7.8	6,300.52	1,307.97
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产		6,778.32	429.19



收入			
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,998.09	-196,525.33
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-167,851.52	-255,521.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	3,552.51	305.94
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	-	-
股利收益	6.4.7.12	182,297.10	58,690.06
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
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	1,305,286.77	-664,853.02
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	158,531.85	1,544.27
<b>减：二、营业总支出</b>		304,747.77	122,038.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	197,084.31	66,882.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	32,847.43	11,147.17
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	34,844.49	5,133.55
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. 税金及附加		38.23	-
8. 其他费用	6.4.7.15	39,933.31	38,874.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,190,147.78	-980,135.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,190,147.78	-980,135.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,190,147.78	-980,135.35

### 6.3 净资产（基金净值）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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	10,650,901.46	-	134,503.80	10,785,405.26
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	10,650,901.46	-	134,503.80	10,785,405.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	27,903,148.11	-	2,107,937.43	30,011,085.54

(一)、综合收益总额	-	-	1,190,147.78	1,190,147.78
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	27,903,148.11	-	917,789.65	28,820,937.76
其中: 1.基金申购款	77,773,758.38	-	3,500,776.01	81,274,534.39
2.基金赎回款	-49,870,610.27	-	-2,582,986.36	-52,453,596.63
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	38,554,049.57	-	2,242,441.23	40,796,490.80
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	8,144,483.63	-	2,262,066.97	10,406,550.60
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差	-	-	-	-

错更正				
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	8,144,483.63	-	2,262,066.97	10,406,550.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	430,794.07	-	-924,967.92	-494,173.85
（一）、综合收益总额	-	-	-980,135.35	-980,135.35
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	430,794.07	-	55,167.43	485,961.50
其中：1.基金申购款	1,218,606.10	-	98,140.28	1,316,746.38
2.基金赎回款	-787,812.03	-	-42,972.85	-830,784.88
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	8,575,277.70	-	1,337,099.05	9,912,376.75

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:

黄凌

谭淼

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。本基金的业绩比较基准为： $60\% \times \text{沪深300指数收益率} + 40\% \times \text{中债综合指数收益率}$ 。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年1月1日至2023年6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2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6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

本基金会计年度为公历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2023年1月1日至2023年6月30日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量

特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2)金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3)衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。对于已开放转换业务的基金，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平准金和未实现平准金。已实现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损益占净资产比例计算的金额。未实现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损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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**

本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。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**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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)本基金的基金管理人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)本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告〔2017〕13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发〔2017〕6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称"指引")，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告〔2017〕13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、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》、财税〔2016〕36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、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》、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》、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》、财税〔2017〕2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、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。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	72,864.44
等于：本金	72,718.53
加：应计利息	145.91
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	2,570,260.16
等于：本金	2,570,214.47
加：应计利息	45.69
减：坏账准备	-
合计	2,643,124.60

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	30,331,158.66	-	30,807,374.59	476,215.93
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	208,000.00	2,683.51	213,160.20	2,476.69
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	208,000.00	2,683.51	213,160.20	2,476.69
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		30,539,158.66	2,683.51	31,020,534.79	478,692.62

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-34.03	-
银行间市场	-	-
合计	-34.03	-

#### 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 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.07
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	126,974.79
其中：交易所市场	126,974.79
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	19,835.79
其他应付	12.45
合计	146,824.10

### 6.4.7.6 实收基金

#### 6.4.7.6.1 中信建投睿利A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投睿利A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,282,161.65	7,282,161.65
本期申购	6,344,153.03	6,344,153.03
本期赎回（以“-”号填列）	-4,388,467.56	-4,388,467.56
本期末	9,237,847.12	9,237,847.12

#### 6.4.7.6.2 中信建投睿利C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投睿利C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,368,739.81	3,368,739.81
本期申购	71,429,605.35	71,429,605.35
本期赎回（以“-”号填列）	-45,482,142.71	-45,482,142.71
本期末	29,316,202.45	29,316,202.45

### 6.4.7.7 未分配利润

#### 6.4.7.7.1 中信建投睿利A

单位：人民币元

项目 (中信建投睿利A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,283,105.01	-1,129,285.19	153,819.82
本期利润	-161,055.16	653,461.79	492,406.63
本期基金份额交易产生的变动数	289,206.20	-184,336.46	104,869.74
其中：基金申购款	940,757.74	-487,107.33	453,650.41
基金赎回款	-651,551.54	302,770.87	-348,780.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,411,256.05	-660,159.86	751,096.19

#### 6.4.7.7.2 中信建投睿利C

单位：人民币元

项目 (中信建投睿利C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	500,752.66	-520,068.68	-19,316.02
本期利润	45,916.17	651,824.98	697,741.15
本期基金份额交易产生的变动数	3,084,488.89	-2,271,568.98	812,919.91
其中：基金申购款	8,579,014.59	-5,531,888.99	3,047,125.60
基金赎回款	-5,494,525.70	3,260,320.01	-2,234,205.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,631,157.72	-2,139,812.68	1,491,345.04

#### 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	4,323.53



定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	45.69
结算备付金利息收入	1,864.06
其他	67.24
合计	6,300.52

#### 6.4.7.9 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	164,364,355.68
减：卖出股票成本总额	164,154,224.05
减：交易费用	377,983.15
买卖股票差价收入	-167,851.52

#### 6.4.7.10 债券投资收益

##### 6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	18,140.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-14,587.76
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	3,552.51

##### 6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股）	4,213,980.00

及债券到期兑付) 成交总额	
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	4,134,587.76
减：应计利息总额	93,980.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-14,587.76

#### 6.4.7.11 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	182,297.10
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	182,297.10

#### 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	1,305,286.77
——股票投资	1,295,039.57
——债券投资	10,247.20
——资产支持证券投资	-
——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	1,305,286.77

#### 6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	158,531.85
合计	158,531.85

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 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,497.52
审计费用	19,835.79
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	39,933.31

### 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、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
元达信资本管理（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

注：元达信资本管理（北京）有限公司于2023年7月更名为中信建投利信资本管理（北京）有限公司。

以下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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	153,003,173.58	43.67%	2,807,163.94	41.05%

##### 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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
中信建投 证券股份 有限公司	3,025,967.25	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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	46,600,000.00	100.00%	4,600,000.00	79.31%

### 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 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例

		例		
中信建投 证券股份 有限公司	81,172.82	43.64%	50,271.70	39.59%
关联方名 称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	1,491.32	36.71%	1,425.80	17.31%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取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。

#### 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 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	197,084.31	66,882.92
其中：支付销售机构的客户维护费	79,239.00	19,255.94

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1.50%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×1.50%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年01月01日至2023年06月30日	2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	32,847.43	11,147.17

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0.25%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×0.25%/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 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投睿利A	中信建投睿利C	合计
中信建投基金管理有限公司	0.00	1,851.02	1,851.02
中信建投证券股份有限公司	0.00	29,931.76	29,931.76
合计	0.00	31,782.78	31,782.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投睿利A	中信建投睿利C	合计
中信建投证券股份有限公司	0.00	62.12	62.12
合计	0.00	62.12	62.12

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

### 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

中信建投睿利A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30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	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	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	2,000,800.00	2,000,800.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.1896%	23.3322%

#### 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

份额单位：份

中信建投睿利C

关联方名称	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022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
元达信资本管理（北京）有限公司	892,618.05	2.3152%	892,618.05	8.3807%



#### 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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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
中国工商银行股份有限公司	72,864.44	4,323.53	686,640.99	1,052.71
中信建投证券股份有限公司	2,570,,260.16	0.00	0.00	0.00

注：本基金的银行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。本基金证券户的存款由中信建投证券股份有限公司保管，按约定利率计息。

#### 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——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

#### 6.4.12 期末（2023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	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	-------	--------	--------	----

						价				
000561	烽火电子	2023-06-30	重大事项	11.57	2023-07-14	12.73	9,200	89,837.51	106,444.00	-

### 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，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，违约风险可能性很小；在银行间同业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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

于2023年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的按短期信用评级列示的债券投资（2022年12月31日：同）。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

#### 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	1,231,461.53
AAA以下	10,663.98	-
未评级	-	-
合计	10,663.98	1,231,461.53

注：以上按长期信用评级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

无余额。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

### 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可随时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2023年6月30日，除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额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。

#### 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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。

本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2023年6月30日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2023年6月30日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资、买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,643,124.60	-	-	-	2,643,124.60
结算备付金	289,425.63	-	-	-	289,425.63
存出保证金	18,743.25	-	-	-	18,743.25
交易性金融资产	202,496.22	-	10,663.98	30,807,374.59	31,020,534.79
买入返售金融资产	-34.03	-	-	-	-34.03
应收申购款	-	-	-	7,029,218.87	7,029,218.87
资产总计	3,153,755.67	-	10,663.98	37,836,593.46	41,001,013.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,135.17	8,135.17
应付管理人报酬	-	-	-	36,662.25	36,662.25
应付托管费	-	-	-	6,110.41	6,110.41
应付销售服务费	-	-	-	6,790.38	6,790.38
其他负债	-	-	-	146,824.10	146,824.10
负债总计	-	-	-	204,522.31	204,522.31
利率敏感度缺口	3,153,755.67	-	10,663.98	37,632,071.15	40,796,490.80
上年度末 2022 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

12月31日					
资产					
银行存款	570,830.95	-	-	-	570,830.95
结算备付金	15,277.99	-	-	-	15,277.99
存出保证金	1,480.94	-	-	-	1,480.94
交易性金融资产	1,333,482.49	-	-	7,685,756.81	9,019,239.30
买入返售金融资产	500,227.82	-	-	-	500,227.82
应收清算款	-	-	-	750,709.61	750,709.61
应收申购款	-	-	-	2,142.25	2,142.25
资产总计	2,421,300.19	-	-	8,438,608.67	10,859,908.86
负债					
应付清算款	-	-	-	9,465.74	9,465.74
应付赎回款	-	-	-	2,033.35	2,033.35
应付管理人报酬	-	-	-	13,935.98	13,935.98
应付托管费	-	-	-	2,322.64	2,322.64
应付销售服务费	-	-	-	1,154.85	1,154.85
应交税费	-	-	-	218.78	218.78
其他负债	-	-	-	45,372.26	45,372.26
负债总计	-	-	-	74,503.60	74,503.60
利率敏感度缺口	2,421,300.19	-	-	8,364,105.07	10,785,405.26

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

于2023年6月30日，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为0.52%（2022年12月31日：12.36%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022年12月31日：同）。

#### 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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 2023年06月30日		上年度末 2022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	30,807,374.59	75.51	7,685,756.81	71.26



交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	10,663.98	0.03	-	-
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	30,818,038.57	75.54	7,685,756.81	71.26

#### 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	575,077.46	808,099.79
	业绩比较基准下降5%	-575,077.46	-808,099.79

#### 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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末	上年度末
---------------	-----	------

	2023年06月30日	2022年12月31日
第一层次	30,818,038.57	7,685,756.81
第二层次	202,496.22	1,333,482.49
第三层次	-	-
合计	31,020,534.79	9,019,239.30

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 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	30,807,374.59	75.14
	其中：股票	30,807,374.59	75.14
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	213,160.20	0.52
	其中：债券	213,160.20	0.52
	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	-34.03	0.00
	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	2,932,550.23	7.15
8	其他各项资产	7,047,962.12	17.19
9	合计	41,001,013.11	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	359,521.00	0.88
B	采矿业	475,442.00	1.17
C	制造业	21,062,658.52	51.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	565,881.55	1.39
E	建筑业	831,682.00	2.04
F	批发和零售业	712,618.10	1.75
G	交通运输、仓储和邮政业	759,321.00	1.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,553,970.17	8.71
J	金融业	17,402.00	0.04
K	房地产业	667,460.00	1.64
L	租赁和商务服务业	709,043.00	1.74
M	科学研究和技术服务业	332,735.25	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	125,268.00	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	51,456.00	0.13
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	473,131.00	1.16
S	综合	109,785.00	0.27
	合计	30,807,374.59	75.51

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

### 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(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	600129	太极集团	3,200	190,368.00	0.47
2	000921	海信家电	6,200	167,090.00	0.41
3	603979	金诚信	4,900	152,390.00	0.37
4	603279	景津装备	4,800	150,528.00	0.37
5	601019	山东出版	16,400	150,388.00	0.37
6	600771	广誉远	4,200	148,134.00	0.36
7	600572	康恩贝	21,600	147,960.00	0.36
8	600363	联创光电	3,900	144,690.00	0.35
9	600312	平高电气	11,600	143,724.00	0.35
10	603033	三维股份	7,000	142,450.00	0.35
11	601326	秦港股份	41,700	140,946.00	0.35
12	002335	科华数据	3,900	140,205.00	0.34
13	600199	金种子酒	5,900	140,066.00	0.34
14	600557	康缘药业	5,100	140,046.00	0.34
15	688023	安恒信息	800	139,768.00	0.34
16	601369	陕鼓动力	15,300	139,383.00	0.34
17	002605	姚记科技	3,000	139,290.00	0.34

18	600422	昆药集团	6,700	138,824.00	0.34
19	002851	麦格米特	3,800	138,586.00	0.34
20	002139	拓邦股份	10,600	138,330.00	0.34
21	002099	海翔药业	16,100	138,299.00	0.34
22	601975	招商南油	48,100	137,566.00	0.34
23	002051	中工国际	11,500	137,195.00	0.34
24	600211	西藏药业	2,300	136,620.00	0.33
25	002126	银轮股份	7,700	136,290.00	0.33
26	688106	金宏气体	5,000	136,000.00	0.33
27	002387	维信诺	14,800	135,716.00	0.33
28	002158	汉钟精机	5,400	134,784.00	0.33
29	600850	电科数字	5,700	134,463.00	0.33
30	600587	新华医疗	3,800	134,254.00	0.33
31	000426	兴业银锡	15,100	134,088.00	0.33
32	600750	江中药业	6,100	133,773.00	0.33
33	002276	万马股份	11,000	133,210.00	0.33
34	300130	新国都	4,700	133,151.00	0.33
35	002221	东华能源	15,300	132,345.00	0.32
36	600478	科力远	18,500	132,090.00	0.32
37	603556	海兴电力	5,200	131,248.00	0.32
38	000682	东方电子	13,500	131,220.00	0.32
39	002698	博实股份	7,500	131,175.00	0.32
40	300674	宇信科技	7,400	130,832.00	0.32
41	000811	冰轮环境	8,300	130,808.00	0.32
42	601137	博威合金	8,400	130,704.00	0.32
43	601126	四方股份	8,600	130,634.00	0.32
44	600835	上海机电	7,600	130,568.00	0.32
45	000950	重药控股	19,400	130,562.00	0.32
46	600197	伊力特	4,800	130,416.00	0.32
47	000555	神州信息	10,600	130,380.00	0.32
48	000928	中钢国际	13,500	130,275.00	0.32

49	603477	巨星农牧	3,900	130,065.00	0.32
50	002434	万里扬	14,500	129,775.00	0.32
51	600586	金晶科技	16,800	129,696.00	0.32
52	600821	金开新能	18,800	129,532.00	0.32
53	600320	振华重工	34,700	129,431.00	0.32
54	600006	东风汽车	21,900	129,429.00	0.32
55	688568	中科星图	1,600	128,928.00	0.32
56	605168	三人行	1,500	128,910.00	0.32
57	600266	城建发展	25,300	128,524.00	0.32
58	300573	兴齐眼药	600	128,280.00	0.31
59	600012	皖通高速	12,200	127,856.00	0.31
60	600206	有研新材	9,700	127,458.00	0.31
61	002859	洁美科技	4,600	127,420.00	0.31
62	600055	万东医疗	6,100	127,063.00	0.31
63	301039	中集车辆	9,600	127,008.00	0.31
64	600728	佳都科技	18,300	126,819.00	0.31
65	600552	凯盛科技	10,700	126,688.00	0.31
66	600639	浦东金桥	10,200	126,582.00	0.31
67	601619	嘉泽新能	27,800	126,490.00	0.31
68	688033	天宜上佳	6,600	126,192.00	0.31
69	002121	科陆电子	17,200	126,076.00	0.31
70	601003	柳钢股份	31,200	126,048.00	0.31
71	002957	科瑞技术	6,200	125,674.00	0.31
72	000420	吉林化纤	33,800	125,398.00	0.31
73	601200	上海环境	13,200	125,268.00	0.31
74	603766	隆鑫通用	23,700	125,136.00	0.31
75	688007	光峰科技	6,000	125,100.00	0.31
76	601890	亚星锚链	10,800	125,064.00	0.31
77	300185	通裕重工	44,800	124,992.00	0.31
78	603306	华懋科技	4,300	124,786.00	0.31
79	603197	保隆科技	2,300	124,775.00	0.31

80	603595	东尼电子	2,900	124,178.00	0.30
81	002237	恒邦股份	11,400	124,146.00	0.30
82	000061	农产品	20,700	123,993.00	0.30
83	300203	聚光科技	6,100	123,647.00	0.30
84	002130	沃尔核材	15,200	123,424.00	0.30
85	002053	云南能投	11,000	123,420.00	0.30
86	603859	能科科技	2,400	122,712.00	0.30
87	603719	良品铺子	4,900	122,549.00	0.30
88	600458	时代新材	10,200	122,298.00	0.30
89	000969	安泰科技	12,900	122,163.00	0.30
90	600477	杭萧钢构	29,800	121,882.00	0.30
91	600059	古越龙山	11,700	121,446.00	0.30
92	600138	中青旅	9,700	121,347.00	0.30
93	600640	国脉文化	10,100	121,301.00	0.30
94	000848	承德露露	13,700	121,245.00	0.30
95	600986	浙文互联	18,900	120,960.00	0.30
95	002446	盛路通信	12,800	120,960.00	0.30
97	600502	安徽建工	22,900	120,912.00	0.30
98	002149	西部材料	7,200	120,888.00	0.30
99	000534	万泽股份	7,200	120,744.00	0.30
100	600537	亿晶光电	15,800	120,712.00	0.30
101	601163	三角轮胎	7,600	120,612.00	0.30
102	000989	九芝堂	8,700	120,408.00	0.30
103	002239	奥特佳	45,000	120,150.00	0.29
104	002334	英威腾	9,400	119,756.00	0.29
105	300181	佐力药业	9,800	119,658.00	0.29
106	603466	风语筑	8,600	119,540.00	0.29
107	600033	福建高速	38,100	119,253.00	0.29
108	300406	九强生物	5,100	118,983.00	0.29
109	603636	南威软件	8,100	118,827.00	0.29
110	002458	益生股份	9,600	118,560.00	0.29

111	603328	依顿电子	14,300	118,404.00	0.29
112	300738	奥飞数据	11,600	118,320.00	0.29
112	300045	华力创通	10,200	118,320.00	0.29
114	002017	东信和平	9,000	117,990.00	0.29
115	300455	航天智装	10,300	117,935.00	0.29
116	301030	仕净科技	1,700	117,470.00	0.29
117	603867	新化股份	2,900	117,450.00	0.29
118	300737	科顺股份	12,800	117,248.00	0.29
119	600635	大众公用	35,300	117,196.00	0.29
120	002270	华明装备	10,700	117,165.00	0.29
121	000885	城发环境	8,800	117,128.00	0.29
122	603035	常熟汽饰	6,000	116,580.00	0.29
123	600125	铁龙物流	19,300	116,572.00	0.29
124	600797	浙大网新	16,300	116,382.00	0.29
125	002782	可立克	7,600	116,204.00	0.28
126	002583	海能达	20,000	116,200.00	0.28
127	300366	创意信息	9,400	116,184.00	0.28
128	600237	铜峰电子	14,100	116,043.00	0.28
129	300134	大富科技	11,300	115,825.00	0.28
130	000922	佳电股份	8,800	115,808.00	0.28
131	600391	航发科技	4,800	115,728.00	0.28
132	000524	岭南控股	10,800	115,668.00	0.28
133	000801	四川九洲	15,800	115,340.00	0.28
134	600531	豫光金铅	18,300	115,290.00	0.28
135	688148	芳源股份	9,400	114,680.00	0.28
136	600248	陕建股份	24,000	114,480.00	0.28
137	002649	博彦科技	8,100	114,453.00	0.28
138	688185	康希诺	1,400	114,100.00	0.28
139	300263	隆华科技	13,700	113,984.00	0.28
140	002345	潮宏基	14,500	113,970.00	0.28
141	002284	亚太股份	12,700	113,919.00	0.28



142	300352	北信源	22,600	113,904.00	0.28
143	601038	一拖股份	9,700	113,878.00	0.28
144	002467	二六三	22,900	113,813.00	0.28
145	300396	迪瑞医疗	3,500	113,715.00	0.28
146	300008	天海防务	22,600	113,678.00	0.28
147	000852	石化机械	15,800	113,602.00	0.28
148	603619	中曼石油	6,700	113,364.00	0.28
149	002815	崇达技术	9,100	113,295.00	0.28
150	600073	上海梅林	15,500	113,150.00	0.28
151	002169	智光电气	13,600	112,744.00	0.28
152	000589	贵州轮胎	20,100	112,560.00	0.28
153	002046	国机精工	8,800	112,288.00	0.28
154	002707	众信旅游	14,900	112,197.00	0.28
155	600855	航天长峰	8,500	111,945.00	0.27
156	001696	宗申动力	15,800	111,864.00	0.27
157	000560	我爱我家	42,200	111,830.00	0.27
158	002635	安洁科技	8,100	111,780.00	0.27
159	600876	凯盛新能	7,000	111,720.00	0.27
160	300348	长亮科技	10,700	111,708.00	0.27
160	002283	天润工业	17,400	111,708.00	0.27
162	605090	九丰能源	5,000	111,650.00	0.27
163	300767	震安科技	4,400	111,584.00	0.27
164	601929	吉视传媒	60,600	111,504.00	0.27
165	300131	英唐智控	21,200	111,300.00	0.27
166	600975	新五丰	11,600	110,896.00	0.27
167	002990	盛视科技	3,000	110,400.00	0.27
168	002611	东方精工	19,200	110,208.00	0.27
169	002238	天威视讯	15,900	110,187.00	0.27
170	300206	理邦仪器	7,300	110,084.00	0.27
171	000045	深纺织A	10,000	110,000.00	0.27
172	603076	乐惠国际	2,300	109,963.00	0.27

173	300145	中金环境	37,400	109,956.00	0.27
174	300184	力源信息	21,900	109,938.00	0.27
175	002829	星网宇达	2,500	109,825.00	0.27
176	600770	综艺股份	19,500	109,785.00	0.27
177	688138	清溢光电	5,200	109,772.00	0.27
178	002367	康力电梯	12,000	109,560.00	0.27
179	300098	高新兴	30,000	109,500.00	0.27
180	002062	宏润建设	20,200	109,282.00	0.27
181	002454	松芝股份	12,900	109,263.00	0.27
182	002170	芭田股份	15,900	109,233.00	0.27
183	003012	东鹏控股	13,500	109,215.00	0.27
184	002632	道明光学	15,000	109,200.00	0.27
185	002421	达实智能	31,000	109,120.00	0.27
186	603808	歌力思	8,300	108,979.00	0.27
187	600419	天润乳业	6,700	108,674.00	0.27
188	605123	派克新材	1,000	108,650.00	0.27
189	688212	澳华内镜	1,600	108,640.00	0.27
190	301087	可孚医疗	2,200	108,460.00	0.27
191	002515	金字火腿	22,700	108,279.00	0.27
192	603366	日出东方	18,600	108,066.00	0.26
193	600756	浪潮软件	6,500	108,030.00	0.26
194	000751	锌业股份	32,700	107,910.00	0.26
195	603663	三祥新材	7,200	107,640.00	0.26
196	002314	南山控股	32,600	107,580.00	0.26
197	301090	华润材料	8,500	107,270.00	0.26
198	002651	利君股份	13,800	107,226.00	0.26
199	600533	栖霞建设	34,800	107,184.00	0.26
200	000672	上峰水泥	11,720	107,003.60	0.26
201	002115	三维通信	16,400	106,928.00	0.26
202	002533	金杯电工	13,100	106,896.00	0.26
203	300887	谱尼测试	2,700	106,866.00	0.26

204	300128	锦富技术	25,600	106,752.00	0.26
205	603339	四方科技	6,700	106,597.00	0.26
206	688299	长阳科技	6,800	106,556.00	0.26
207	002376	新北洋	13,200	106,524.00	0.26
208	300276	三丰智能	25,300	106,513.00	0.26
209	000561	烽火电子	9,200	106,444.00	0.26
210	600961	株冶集团	13,100	105,979.00	0.26
211	300802	矩子科技	4,400	105,908.00	0.26
212	600512	腾达建设	39,500	105,860.00	0.26
213	002559	亚威股份	11,900	105,672.00	0.26
214	688560	明冠新材	3,800	105,602.00	0.26
215	301015	百洋医药	3,800	105,488.00	0.26
216	003040	楚天龙	5,800	105,212.00	0.26
217	300127	银河磁体	5,800	105,154.00	0.26
218	300718	长盛轴承	4,700	104,575.00	0.26
219	603330	天洋新材	9,400	104,434.00	0.26
220	603158	腾龙股份	13,600	104,176.00	0.26
221	603630	拉芳家化	6,500	103,805.00	0.25
222	300951	博硕科技	1,900	103,797.00	0.25
223	003006	百亚股份	6,000	103,680.00	0.25
224	300314	戴维医疗	4,900	103,586.00	0.25
225	601921	浙版传媒	11,900	103,411.00	0.25
226	688626	翔宇医疗	2,265	103,080.15	0.25
227	301051	信濠光电	1,700	102,833.00	0.25
228	300532	今天国际	5,000	102,800.00	0.25
229	600960	渤海汽车	27,200	102,544.00	0.25
230	300231	银信科技	11,500	102,465.00	0.25
231	300856	科思股份	1,300	102,401.00	0.25
232	300259	新天科技	25,500	102,255.00	0.25
233	688133	泰坦科技	1,200	102,228.00	0.25
234	300248	新开普	9,800	102,214.00	0.25

235	300925	法本信息	7,200	101,736.00	0.25
236	300420	五洋停车	31,000	101,680.00	0.25
237	300040	九洲集团	16,200	101,574.00	0.25
238	605009	豪悦护理	2,100	100,800.00	0.25
239	300830	金现代	10,600	100,700.00	0.25
240	300863	卡倍亿	1,600	100,656.00	0.25
241	300909	汇创达	3,800	100,396.00	0.25
242	300881	盛德鑫泰	3,040	100,168.00	0.25
243	002448	中原内配	14,300	100,100.00	0.25
244	300860	锋尚文化	1,800	99,792.00	0.24
245	002991	甘源食品	1,300	99,710.00	0.24
246	605286	同力日升	3,400	98,328.00	0.24
247	300510	金冠股份	14,000	97,720.00	0.24
248	300902	国安达	2,600	97,370.00	0.24
249	300978	东箭科技	7,100	96,773.00	0.24
250	002612	朗姿股份	3,900	92,742.00	0.23
251	002833	弘亚数控	4,600	90,436.00	0.22
252	002285	世联行	33,500	85,760.00	0.21
253	002832	比音勒芬	2,300	81,443.00	0.20
254	000685	中山公用	10,700	80,999.00	0.20
255	600590	泰豪科技	10,900	77,717.00	0.19
256	000923	河钢资源	5,600	75,600.00	0.19
257	300546	雄帝科技	4,010	73,904.30	0.18
258	300687	赛意信息	2,400	66,672.00	0.16
259	002137	实益达	9,600	66,336.00	0.16
260	002038	双鹭药业	6,503	65,615.27	0.16
261	603377	东方时尚	6,400	51,456.00	0.13
262	600307	酒钢宏兴	29,300	45,415.00	0.11
263	688111	金山办公	88	41,555.36	0.10
264	000049	德赛电池	1,100	38,808.00	0.10
265	300627	华测导航	1,100	35,717.00	0.09

266	300415	伊之密	1,400	26,880.00	0.07
267	300379	东方通	1,300	26,741.00	0.07
268	002891	中宠股份	1,000	24,140.00	0.06
269	603611	诺力股份	900	23,706.00	0.06
270	300394	天孚通信	200	21,366.00	0.05
271	002322	理工能科	2,000	20,800.00	0.05
272	688663	新风光	600	19,074.00	0.05
273	601963	重庆银行	2,200	17,402.00	0.04
274	688667	菱电电控	83	6,194.29	0.02
275	688711	宏微科技	40	2,333.60	0.01
276	688700	东威科技	21	2,094.33	0.01
277	688262	国芯科技	49	1,993.81	0.00
278	688733	壹石通	58	1,795.68	0.00
279	688008	澜起科技	25	1,435.50	0.00
280	300827	上能电气	30	1,081.50	0.00
281	605020	永和股份	40	1,032.40	0.00
282	688315	诺禾致源	35	929.25	0.00
283	000028	国药一致	10	436.10	0.00
284	603011	合锻智能	20	158.00	0.00
285	002300	太阳电缆	10	87.90	0.00
286	600283	钱江水利	1	14.55	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	002276	万马股份	613,544.00	5.69
2	601019	山东出版	597,706.00	5.54
3	600502	安徽建工	583,629.00	5.41
4	600422	昆药集团	575,762.00	5.34

5	000600	建投能源	570,999.00	5.29
6	002158	汉钟精机	559,099.00	5.18
7	002517	恺英网络	558,328.00	5.18
8	000555	神州信息	546,311.00	5.07
9	600850	电科数字	538,600.00	4.99
10	000928	中钢国际	532,986.00	4.94
11	300532	今天国际	525,241.00	4.87
12	000921	海信家电	522,002.00	4.84
13	300510	金冠股份	521,495.00	4.84
14	002605	姚记科技	517,362.00	4.80
15	688686	奥普特	501,311.91	4.65
16	605168	三人行	495,572.00	4.59
17	300827	上能电气	492,154.14	4.56
18	000848	承德露露	489,038.00	4.53
19	002126	银轮股份	487,704.00	4.52
20	600770	综艺股份	479,466.00	4.45
21	002387	维信诺	478,045.00	4.43
22	600129	太极集团	472,975.00	4.39
23	300036	超图软件	472,828.00	4.38
24	601326	秦港股份	468,912.00	4.35
25	002063	远光软件	468,491.00	4.34
26	002017	东信和平	456,630.00	4.23
27	603212	赛伍技术	454,259.86	4.21
28	601619	嘉泽新能	443,693.00	4.11
29	300614	百川畅银	439,468.46	4.07
30	600138	中青旅	437,232.00	4.05
31	600320	振华重工	428,403.00	3.97
32	300128	锦富技术	427,283.00	3.96
33	300026	红日药业	426,547.00	3.95
34	002284	亚太股份	423,104.00	3.92
35	600971	恒源煤电	420,191.00	3.90

36	002061	浙江交科	417,009.00	3.87
37	002335	科华数据	413,865.00	3.84
38	603306	华懋科技	413,271.00	3.83
39	605009	豪悦护理	411,414.00	3.81
40	002237	恒邦股份	410,205.00	3.80
41	600211	西藏药业	409,916.00	3.80
42	600391	航发科技	409,262.00	3.79
43	300802	矩子科技	408,006.00	3.78
44	000917	电广传媒	407,388.00	3.78
45	600459	贵研铂业	405,006.50	3.76
46	688100	威胜信息	404,758.51	3.75
47	688278	特宝生物	404,477.53	3.75
48	600986	浙文互联	403,446.00	3.74
49	002334	英威腾	402,387.00	3.73
50	300863	卡倍亿	398,332.00	3.69
51	003006	百亚股份	396,818.00	3.68
52	002707	众信旅游	393,797.00	3.65
53	603258	电魂网络	392,986.00	3.64
54	002869	金溢科技	392,333.00	3.64
55	600055	万东医疗	390,983.00	3.63
56	600710	苏美达	389,903.00	3.62
57	603719	良品铺子	387,215.79	3.59
58	600012	皖通高速	386,204.00	3.58
59	000534	万泽股份	386,167.00	3.58
60	600975	新五丰	385,339.00	3.57
61	000922	佳电股份	384,758.00	3.57
62	603377	东方时尚	383,434.00	3.56
63	601226	华电重工	381,915.00	3.54
64	688029	南微医学	381,581.97	3.54
65	600531	豫光金铅	381,231.00	3.53
66	603567	珍宝岛	380,661.00	3.53

67	601929	吉视传媒	379,217.00	3.52
68	600419	天润乳业	378,718.00	3.51
69	301039	中集车辆	377,455.00	3.50
70	603556	海兴电力	376,539.00	3.49
71	603328	依顿电子	376,517.00	3.49
72	301155	海力风电	375,353.00	3.48
73	688185	康希诺	375,204.96	3.48
74	600729	重庆百货	375,128.00	3.48
75	603393	新天然气	374,487.00	3.47
76	002062	宏润建设	373,057.00	3.46
77	002458	益生股份	372,604.00	3.45
78	600876	凯盛新能	372,004.00	3.45
79	002421	达实智能	370,994.00	3.44
80	600587	新华医疗	370,979.00	3.44
81	600266	城建发展	369,269.00	3.42
82	002130	沃尔核材	367,996.00	3.41
83	002046	国机精工	367,537.00	3.41
84	600771	广誉远	364,892.70	3.38
85	000589	贵州轮胎	364,007.00	3.37
86	603983	丸美股份	362,935.29	3.37
87	002698	博实股份	362,556.00	3.36
88	000420	吉林化纤	358,887.00	3.33
89	002628	成都路桥	357,662.00	3.32
90	600425	青松建化	356,353.00	3.30
91	300848	美瑞新材	356,161.00	3.30
92	300737	科顺股份	355,929.00	3.30
93	002079	苏州固锝	354,816.00	3.29
94	002967	广电计量	354,532.00	3.29
95	002239	奥特佳	353,785.00	3.28
96	600073	上海梅林	352,657.00	3.27
97	000735	罗牛山	352,254.00	3.27



98	605337	李子园	351,494.00	3.26
99	002345	潮宏基	350,830.00	3.25
100	002283	天润工业	350,619.00	3.25
101	300348	长亮科技	350,211.00	3.25
102	000737	北方铜业	348,981.00	3.24
103	300101	振芯科技	347,784.00	3.22
104	300860	锋尚文化	347,757.00	3.22
105	600458	时代新材	347,071.00	3.22
106	600477	杭萧钢构	346,088.00	3.21
107	600537	亿晶光电	345,727.00	3.21
108	002004	华邦健康	344,931.00	3.20
109	300008	天海防务	344,372.00	3.19
110	601801	皖新传媒	343,804.00	3.19
111	600509	天富能源	343,258.00	3.18
112	300286	安科瑞	342,944.00	3.18
113	002990	盛视科技	341,768.00	3.17
114	000852	石化机械	341,281.00	3.16
115	601965	中国汽研	338,575.00	3.14
116	688630	芯碁微装	337,582.74	3.13
117	603466	风语筑	337,518.00	3.13
118	002020	京新药业	337,482.00	3.13
119	300132	青松股份	337,386.00	3.13
120	002135	东南网架	335,802.00	3.11
121	603171	税友股份	335,705.00	3.11
122	603505	金石资源	333,993.00	3.10
123	002533	金杯电工	329,967.00	3.06
124	301015	百洋医药	329,730.00	3.06
125	300377	赢时胜	329,614.00	3.06
126	300455	航天智装	329,533.00	3.06
127	603859	能科科技	328,798.00	3.05
128	600199	金种子酒	328,331.00	3.04

129	002240	盛新锂能	328,265.00	3.04
130	300982	苏文电能	326,964.00	3.03
131	002390	信邦制药	325,027.00	3.01
132	002215	诺普信	324,233.00	3.01
133	002099	海翔药业	324,213.00	3.01
134	688366	昊海生科	323,284.86	3.00
135	002803	吉宏股份	321,858.00	2.98
136	600237	铜峰电子	321,183.00	2.98
137	603011	合锻智能	320,199.40	2.97
138	003012	东鹏控股	320,009.00	2.97
139	000524	岭南控股	319,325.00	2.96
140	605020	永和股份	318,280.00	2.95
141	000888	峨眉山A	318,058.00	2.95
142	300951	博硕科技	317,583.00	2.94
143	688568	中科星图	315,380.24	2.92
144	002807	江阴银行	315,200.00	2.92
145	002154	报喜鸟	314,462.00	2.92
146	600283	钱江水利	314,315.38	2.91
147	300909	汇创达	313,967.00	2.91
148	600757	长江传媒	313,874.00	2.91
149	300908	仲景食品	313,147.00	2.90
150	002121	科陆电子	312,521.00	2.90
151	002819	东方中科	311,845.00	2.89
152	000793	华闻集团	311,634.00	2.89
153	300183	东软载波	310,828.00	2.88
154	301090	华润材料	309,970.00	2.87
155	002908	德生科技	309,121.00	2.87
156	300130	新国都	308,765.00	2.86
157	002285	世联行	308,003.00	2.86
158	000557	西部创业	307,633.00	2.85
159	688221	前沿生物	306,891.18	2.85

160	688266	泽璟制药	306,832.72	2.84
161	600855	航天长峰	306,379.00	2.84
162	300833	浩洋股份	305,223.00	2.83
163	600363	联创光电	305,138.00	2.83
164	600312	平高电气	304,817.00	2.83
165	002194	武汉凡谷	304,799.00	2.83
166	001696	宗申动力	304,400.00	2.82
167	300465	高伟达	304,234.00	2.82
168	688578	艾力斯	303,864.28	2.82
169	300425	中建环能	303,617.00	2.82
170	603323	苏农银行	302,881.00	2.81
171	600572	康恩贝	301,898.00	2.80
172	000543	皖能电力	301,109.00	2.79
173	300925	法本信息	300,969.00	2.79
174	000682	东方电子	300,269.95	2.78
175	600125	铁龙物流	299,855.00	2.78
176	600761	安徽合力	298,872.00	2.77
177	300869	康泰医学	297,249.00	2.76
178	603662	柯力传感	296,290.00	2.75
179	600728	佳都科技	296,210.00	2.75
180	603339	四方科技	296,002.00	2.74
181	688148	芳源股份	295,743.69	2.74
182	000426	兴业银锡	294,014.00	2.73
183	002238	天威视讯	293,405.00	2.72
184	600933	爱柯迪	293,049.00	2.72
185	300181	佐力药业	292,618.00	2.71
186	000665	湖北广电	292,470.00	2.71
187	600197	伊力特	291,917.00	2.71
188	000726	鲁泰A	291,696.00	2.70
189	000719	中原传媒	291,351.00	2.70
190	600616	金枫酒业	290,226.00	2.69

191	600360	华微电子	290,096.00	2.69
192	600639	浦东金桥	289,859.00	2.69
193	688617	惠泰医疗	289,436.33	2.68
194	300484	蓝海华腾	289,319.00	2.68
195	603058	永吉股份	289,267.00	2.68
196	300276	三丰智能	288,249.00	2.67
197	300799	*ST左江	287,632.00	2.67
198	600552	凯盛科技	286,649.00	2.66
199	000650	仁和药业	285,255.00	2.64
200	600581	八一钢铁	284,925.00	2.64
201	603979	金诚信	284,901.00	2.64
202	002139	拓邦股份	284,759.00	2.64
203	600750	江中药业	284,368.00	2.64
204	601003	柳钢股份	284,297.00	2.64
205	688680	海优新材	283,822.82	2.63
206	000901	航天科技	283,587.00	2.63
207	600821	金开新能	282,841.00	2.62
208	300232	洲明科技	282,339.00	2.62
209	600651	飞乐音响	281,828.00	2.61
210	688711	宏微科技	281,681.80	2.61
211	688106	金宏气体	278,321.06	2.58
212	000028	国药一致	277,951.00	2.58
213	300303	聚飞光电	277,930.00	2.58
214	002851	麦格米特	277,695.00	2.57
215	300493	润欣科技	277,342.00	2.57
216	000811	冰轮环境	274,620.00	2.55
217	300543	朗科智能	274,361.00	2.54
218	603595	东尼电子	274,290.00	2.54
219	605388	均瑶健康	273,856.00	2.54
220	605090	九丰能源	273,758.00	2.54
221	300962	中金辐照	273,628.00	2.54

222	002544	普天科技	272,718.00	2.53
223	600736	苏州高新	272,532.00	2.53
224	000567	海德股份	271,502.00	2.52
225	603915	国茂股份	271,258.00	2.52
226	300507	苏奥传感	270,372.00	2.51
227	002612	朗姿股份	269,818.00	2.50
228	002344	海宁皮城	269,212.00	2.50
229	603078	江化微	268,828.00	2.49
230	603220	中贝通信	268,809.00	2.49
231	300382	斯莱克	268,775.00	2.49
232	002038	双鹭药业	267,318.48	2.48
233	000923	河钢资源	266,526.00	2.47
234	002170	芭田股份	265,842.00	2.46
235	600158	中体产业	264,949.00	2.46
236	002915	中欣氟材	264,379.00	2.45
237	002928	华夏航空	264,206.00	2.45
238	603033	三维股份	263,986.00	2.45
239	002957	科瑞技术	263,944.00	2.45
240	002583	海能达	263,265.00	2.44
241	300791	仙乐健康	262,956.00	2.44
242	601028	玉龙股份	262,430.00	2.43
243	000885	城发环境	262,138.00	2.43
244	600835	上海机电	261,878.00	2.43
245	600776	东方通信	260,610.00	2.42
246	600861	北京人力	259,973.00	2.41
247	300878	维康药业	257,540.00	2.39
248	300858	科拓生物	257,242.00	2.39
249	002852	道道全	256,916.00	2.38
250	002270	华明装备	256,641.00	2.38
251	600059	古越龙山	256,609.00	2.38
252	300226	上海钢联	255,209.00	2.37

253	002905	金逸影视	254,991.00	2.36
254	601200	上海环境	254,398.00	2.36
255	002484	江海股份	253,962.00	2.35
256	002137	实益达	253,796.00	2.35
257	000576	甘化科工	253,305.00	2.35
258	300315	掌趣科技	253,279.00	2.35
259	601068	中铝国际	253,177.00	2.35
260	000657	中钨高新	252,831.00	2.34
261	000836	富通信息	252,122.00	2.34
262	300080	易成新能	251,375.00	2.33
263	002317	众生药业	250,384.00	2.32
264	601975	招商南油	248,301.00	2.30
265	300420	五洋停车	247,878.00	2.30
266	002632	道明光学	247,407.00	2.29
267	002432	九安医疗	247,023.00	2.29
268	603477	巨星农牧	245,611.00	2.28
269	300765	新诺威	245,167.00	2.27
270	600864	哈投股份	244,492.00	2.27
271	300719	安达维尔	243,820.00	2.26
272	002859	洁美科技	243,018.00	2.25
273	601512	中新集团	242,963.00	2.25
274	600961	株冶集团	242,770.00	2.25
275	002324	普利特	242,637.00	2.25
276	000751	锌业股份	242,522.00	2.25
277	300263	隆华科技	242,439.00	2.25
278	300147	香雪制药	242,275.00	2.25
279	600602	云赛智联	242,252.00	2.25
280	688700	东威科技	242,101.48	2.24
281	300830	金现代	241,217.00	2.24
282	000758	中色股份	241,113.00	2.24
283	603611	诺力股份	240,862.00	2.23

284	600103	青山纸业	240,451.00	2.23
285	688157	松井股份	240,271.70	2.23
286	300098	高新兴	239,962.00	2.22
287	002160	常铝股份	239,583.00	2.22
288	600501	航天晨光	239,343.00	2.22
289	002036	联创电子	239,068.00	2.22
290	600815	厦工股份	239,033.00	2.22
291	600420	国药现代	238,395.00	2.21
292	002885	京泉华	238,370.00	2.21
293	603867	新化股份	238,332.00	2.21
294	300083	创世纪	237,966.00	2.21
295	002302	西部建设	237,302.00	2.20
296	002837	英维克	236,296.00	2.19
297	002424	贵州百灵	235,476.00	2.18
298	600756	浪潮软件	234,863.00	2.18
299	688007	光峰科技	234,351.92	2.17
300	600200	江苏吴中	233,081.00	2.16
301	601038	一拖股份	233,012.00	2.16
302	603103	横店影视	231,559.00	2.15
303	002891	中宠股份	231,550.00	2.15
304	300738	奥飞数据	231,407.00	2.15
305	002149	西部材料	231,108.00	2.14
306	002991	甘源食品	230,877.00	2.14
307	300047	天源迪科	230,679.00	2.14
308	600513	联环药业	230,477.00	2.14
309	002212	天融信	229,110.00	2.12
310	002847	盐津铺子	228,987.00	2.12
311	000560	我爱我家	228,806.00	2.12
312	600054	黄山旅游	228,142.00	2.12
313	002454	松芝股份	226,604.00	2.10
314	002445	中南文化	226,433.00	2.10

315	600307	酒钢宏兴	225,345.00	2.09
316	002035	华帝股份	225,293.00	2.09
317	000561	烽火电子	224,431.00	2.08
318	603630	拉芳家化	224,256.00	2.08
319	002434	万里扬	224,034.00	2.08
320	002367	康力电梯	223,915.00	2.08
321	300679	电连技术	223,671.00	2.07
322	688289	圣湘生物	222,862.58	2.07
323	600284	浦东建设	222,212.00	2.06
324	600210	紫江企业	221,822.00	2.06
325	002163	海南发展	221,709.00	2.06
326	300793	佳禾智能	221,633.00	2.05
327	002635	安洁科技	220,141.00	2.04
328	600252	中恒集团	220,106.00	2.04
329	600780	通宝能源	219,796.00	2.04
330	300199	翰宇药业	219,405.00	2.03
331	600201	生物股份	218,765.00	2.03
332	300456	赛微电子	216,197.00	2.00

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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	002908	德生科技	935,426.00	8.67
2	002179	中航光电	714,126.20	6.62
3	688282	理工导航	658,951.91	6.11
4	000600	建投能源	592,443.00	5.49
5	300026	红日药业	590,458.00	5.47
6	002517	恺英网络	585,941.00	5.43
7	688262	国芯科技	572,645.66	5.31
8	002605	姚记科技	500,976.00	4.64



9	688686	奥普特	495,260.72	4.59
10	002276	万马股份	493,535.00	4.58
11	601019	山东出版	491,256.00	4.55
12	600422	昆药集团	488,801.00	4.53
13	300036	超图软件	480,600.00	4.46
14	300827	上能电气	478,691.28	4.44
15	600502	安徽建工	465,957.00	4.32
16	300510	金冠股份	463,621.00	4.30
17	002063	远光软件	459,103.00	4.26
18	300614	百川畅银	458,856.00	4.25
19	000928	中钢国际	449,265.00	4.17
20	600710	苏美达	434,101.00	4.02
21	603212	赛伍技术	431,592.00	4.00
22	600757	长江传媒	430,787.00	3.99
23	688278	特宝生物	424,018.10	3.93
24	601801	皖新传媒	421,324.00	3.91
25	002158	汉钟精机	418,020.00	3.88
26	300532	今天国际	417,439.00	3.87
27	002061	浙江交科	416,212.40	3.86
28	600971	恒源煤电	410,646.00	3.81
29	000555	神州信息	410,444.00	3.81
30	000917	电广传媒	410,091.00	3.80
31	603258	电魂网络	407,562.00	3.78
32	300627	华测导航	404,858.00	3.75
33	600459	贵研铂业	402,572.00	3.73
34	000921	海信家电	401,790.00	3.73
35	688100	威胜信息	400,398.13	3.71
36	603567	珍宝岛	400,140.00	3.71
37	601326	秦港股份	398,604.00	3.70
38	000519	中兵红箭	398,304.00	3.69
39	600729	重庆百货	396,182.00	3.67

40	688029	南微医学	395,166.29	3.66
41	600850	电科数字	385,153.00	3.57
42	002126	银轮股份	383,811.00	3.56
43	002079	苏州固锔	376,688.00	3.49
44	600425	青松建化	375,309.00	3.48
45	603882	金城医学	371,927.00	3.45
46	000848	承德露露	368,518.00	3.42
47	601226	华电重工	367,972.00	3.41
48	605168	三人行	367,908.00	3.41
49	002967	广电计量	367,310.00	3.41
50	002869	金溢科技	364,671.00	3.38
51	603393	新天然气	363,301.00	3.37
52	600509	天富能源	362,743.00	3.36
53	301155	海力风电	358,132.00	3.32
54	002020	京新药业	355,292.00	3.29
55	000888	峨眉山A	354,794.00	3.29
56	002166	莱茵生物	354,369.00	3.29
57	002387	维信诺	352,697.00	3.27
58	300049	福瑞股份	348,085.00	3.23
59	600129	太极集团	346,967.00	3.22
60	603983	丸美股份	345,326.00	3.20
61	300848	美瑞新材	344,906.00	3.20
62	002017	东信和平	344,558.00	3.19
63	002628	成都路桥	344,122.00	3.19
64	600283	钱江水利	343,322.00	3.18
65	300286	安科瑞	342,480.00	3.18
66	601965	中国汽研	340,973.00	3.16
67	605337	李子园	339,042.00	3.14
68	002154	报喜鸟	336,241.00	3.12
69	688630	芯碁微装	336,010.17	3.12
70	300232	洲明科技	335,823.00	3.11

71	002004	华邦健康	335,292.00	3.11
72	600770	综艺股份	334,170.00	3.10
73	603011	合锻智能	333,877.00	3.10
74	688266	泽璟制药	333,586.63	3.09
75	002215	诺普信	333,395.00	3.09
76	000737	北方铜业	331,802.00	3.08
77	688578	艾力斯	331,033.95	3.07
78	000543	皖能电力	330,025.00	3.06
79	605020	永和股份	328,987.00	3.05
80	601619	嘉泽新能	328,987.00	3.05
81	000735	罗牛山	328,905.00	3.05
82	000028	国药一致	328,761.00	3.05
83	002135	东南网架	328,235.00	3.04
84	300303	聚飞光电	326,891.00	3.03
85	300908	仲景食品	326,811.00	3.03
86	600651	飞乐音响	326,423.00	3.03
87	300982	苏文电能	325,602.00	3.02
88	002240	盛新锂能	324,542.00	3.01
89	688700	东威科技	324,183.68	3.01
90	002390	信邦制药	323,909.00	3.00
91	688366	昊海生科	323,480.69	3.00
92	603129	春风动力	322,189.00	2.99
93	605009	豪悦护理	322,105.18	2.99
94	002194	武汉凡谷	320,534.00	2.97
95	300128	锦富技术	319,477.00	2.96
96	300132	青松股份	319,368.00	2.96
97	603171	税友股份	318,844.00	2.96
98	002334	英威腾	318,096.00	2.95
99	603377	东方时尚	317,269.00	2.94
100	000557	西部创业	316,561.00	2.94
101	688221	前沿生物	315,739.09	2.93

102	002807	江阴银行	315,066.00	2.92
103	300465	高伟达	314,686.00	2.92
104	002819	东方中科	313,686.00	2.91
105	603505	金石资源	313,376.00	2.91
106	002284	亚太股份	313,203.00	2.90
107	300802	矩子科技	312,809.00	2.90
108	300377	赢时胜	311,279.00	2.89
109	603662	柯力传感	310,015.00	2.87
110	600761	安徽合力	309,136.00	2.87
111	300315	掌趣科技	309,133.00	2.87
112	300833	浩洋股份	309,097.00	2.87
113	300101	振芯科技	308,630.00	2.86
114	300799	*ST左江	308,513.00	2.86
115	300183	东软载波	304,866.00	2.83
116	000793	华闻集团	304,669.00	2.82
117	600138	中青旅	301,104.00	2.79
118	300493	润欣科技	298,970.00	2.77
119	603058	永吉股份	298,397.00	2.77
120	603323	苏农银行	296,304.00	2.75
121	000567	海德股份	295,884.00	2.74
122	600391	航发科技	294,796.00	2.73
123	002803	吉宏股份	294,496.00	2.73
124	301039	中集车辆	293,442.00	2.72
125	300425	中建环能	292,593.00	2.71
126	601068	中铝国际	292,175.00	2.71
127	000901	航天科技	291,540.00	2.70
128	300869	康泰医学	291,133.00	2.70
129	688617	惠泰医疗	290,434.00	2.69
130	003006	百亚股份	289,405.00	2.68
131	002237	恒邦股份	288,002.00	2.67
132	600616	金枫酒业	287,126.00	2.66

133	300863	卡倍亿	286,885.00	2.66
134	600320	振华重工	286,732.00	2.66
135	300484	蓝海华腾	281,195.00	2.61
136	300765	新诺威	281,013.00	2.61
137	603078	江化微	280,893.00	2.60
138	600419	天润乳业	280,672.00	2.60
139	000534	万泽股份	279,502.00	2.59
140	600211	西藏药业	279,422.00	2.59
141	002905	金逸影视	278,861.00	2.59
142	600602	云赛智联	278,824.00	2.59
143	000726	鲁泰A	278,440.00	2.58
144	603220	中贝通信	278,398.00	2.58
145	600420	国药现代	277,709.00	2.57
146	600581	八一钢铁	277,706.00	2.57
147	688111	金山办公	277,077.98	2.57
148	300382	斯莱克	276,687.00	2.57
149	600531	豫光金铅	276,517.00	2.56
150	000650	仁和药业	276,189.00	2.56
151	600158	中体产业	274,233.00	2.54
152	002344	海宁皮城	273,632.00	2.54
153	000922	佳电股份	271,942.00	2.52
154	600986	浙文互联	271,385.00	2.52
155	600776	东方通信	270,943.00	2.51
156	600055	万东医疗	269,763.00	2.50
157	605388	均瑶健康	269,738.00	2.50
158	000665	湖北广电	269,400.00	2.50
159	603915	国茂股份	269,294.00	2.50
160	002049	紫光国微	268,127.80	2.49
161	300962	中金辐照	267,815.00	2.48
162	600360	华微电子	266,550.00	2.47
163	002915	中欣氟材	266,550.00	2.47

164	002317	众生药业	266,258.00	2.47
165	002335	科华数据	265,033.00	2.46
166	603306	华懋科技	263,768.00	2.45
167	300543	朗科智能	263,732.00	2.45
168	300770	新媒股份	262,954.00	2.44
169	000719	中原传媒	262,587.00	2.43
170	601028	玉龙股份	262,460.00	2.43
171	002837	英维克	262,143.00	2.43
172	300226	上海钢联	262,044.00	2.43
173	600933	爱柯迪	261,309.00	2.42
174	300389	艾比森	260,944.00	2.42
175	600736	苏州高新	260,628.00	2.42
176	603556	海兴电力	259,346.00	2.40
177	002302	西部建设	257,670.00	2.39
178	600501	航天晨光	256,806.00	2.38
179	002707	众信旅游	256,173.00	2.38
180	002415	海康威视	256,122.00	2.37
181	600587	新华医疗	255,923.00	2.37
182	600975	新五丰	255,755.00	2.37
183	603103	横店影视	255,388.00	2.37
184	002324	普利特	254,974.00	2.36
185	300168	万达信息	254,627.00	2.36
186	600012	皖通高速	254,037.00	2.36
187	603328	依顿电子	253,962.00	2.35
188	002062	宏润建设	253,208.00	2.35
189	002544	普天科技	252,622.00	2.34
190	300858	科拓生物	252,506.00	2.34
191	002046	国机精工	252,485.00	2.34
192	002458	益生股份	252,341.00	2.34
193	601929	吉视传媒	251,087.00	2.33
194	000657	中钨高新	250,746.00	2.32

195	000576	甘化科工	250,597.00	2.32
196	002283	天润工业	250,421.00	2.32
197	300507	苏奥传感	250,193.00	2.32
198	300719	安达维尔	250,025.00	2.32
199	002345	潮宏基	249,409.00	2.31
200	002432	九安医疗	249,240.00	2.31
201	600876	凯盛新能	249,071.00	2.31
202	002130	沃尔核材	248,748.00	2.31
203	002928	华夏航空	248,062.00	2.30
204	600864	哈投股份	245,965.00	2.28
205	300791	仙乐健康	245,251.00	2.27
206	688711	宏微科技	244,508.78	2.27
207	002484	江海股份	244,462.00	2.27
208	002421	达实智能	244,401.00	2.27
209	000589	贵州轮胎	244,207.00	2.26
210	300348	长亮科技	244,125.00	2.26
211	300878	维康药业	243,850.00	2.26
212	601512	中新集团	243,314.00	2.26
213	600266	城建发展	243,262.00	2.26
214	000048	京基智农	243,023.00	2.25
215	600103	青山纸业	241,839.00	2.24
216	002852	道道全	240,722.00	2.23
217	000420	吉林化纤	240,363.00	2.23
218	300080	易成新能	240,144.00	2.23
219	300147	香雪制药	239,830.00	2.22
220	600861	北京人力	238,738.00	2.21
221	002307	北新路桥	237,140.00	2.20
222	600054	黄山旅游	236,516.00	2.19
223	002990	盛视科技	236,107.00	2.19
224	300083	创世纪	235,919.00	2.19
225	002698	博实股份	235,751.00	2.19

226	600201	生物股份	235,487.00	2.18
227	300455	航天智装	235,393.00	2.18
228	300456	赛微电子	234,893.00	2.18
229	688680	海优新材	234,058.46	2.17
230	000852	石化机械	233,946.00	2.17
231	000836	富通信息	233,581.00	2.17
232	300860	锋尚文化	233,488.00	2.16
233	603055	台华新材	233,364.00	2.16
234	000758	中色股份	233,359.00	2.16
235	688185	康希诺	233,000.33	2.16
236	300684	中石科技	232,805.00	2.16
237	002847	盐津铺子	231,911.00	2.15
238	002533	金杯电工	231,404.00	2.15
239	600815	厦工股份	230,309.00	2.14
240	002885	京泉华	230,224.00	2.13
241	002160	常铝股份	229,297.00	2.13
242	002424	贵州百灵	228,850.00	2.12
243	603920	世运电路	228,723.00	2.12
244	002300	太阳电缆	228,355.00	2.12
245	000999	华润三九	228,332.00	2.12
246	600458	时代新材	227,169.00	2.11
247	002445	中南文化	225,940.00	2.09
248	600664	哈药股份	225,747.00	2.09
249	603466	风语筑	224,736.00	2.08
250	300008	天海防务	224,503.00	2.08
251	603719	良品铺子	224,321.00	2.08
252	688157	松井股份	223,941.88	2.08
253	600073	上海梅林	223,506.00	2.07
254	300737	科顺股份	222,974.00	2.07
255	002239	奥特佳	221,854.00	2.06
256	600200	江苏吴中	221,549.00	2.05



257	300130	新国都	221,216.00	2.05
258	000777	中核科技	220,451.00	2.04
259	300793	佳禾智能	220,190.00	2.04
260	600513	联环药业	220,170.00	2.04
261	000524	岭南控股	219,772.00	2.04
262	603611	诺力股份	219,223.00	2.03
263	301015	百洋医药	219,063.00	2.03
264	002035	华帝股份	218,612.00	2.03
265	603300	华铁应急	218,185.00	2.02
266	600780	通宝能源	218,028.00	2.02
267	600452	涪陵电力	217,559.00	2.02
268	300199	翰宇药业	217,065.00	2.01
269	300762	上海瀚讯	216,350.00	2.01
270	000837	秦川机床	215,747.00	2.00

### 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	185,980,802.26
卖出股票收入（成交）总额	164,364,355.68

### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	202,496.22	0.50
	其中：政策性金融债	202,496.22	0.50
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)	10,663.98	0.03

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	213,160.20	0.52

### 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	018065	进出2201	2,000	202,496.22	0.50
2	123175	百畅转债	86	10,663.98	0.03

### 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

无余额。

### 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

无余额。

### 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

无余额。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

### 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	18,743.25
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,029,218.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,047,962.12

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

### 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)	人均持有的基金份额	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	530	17,429.90	2,000,800.00	21.6587%	7,237,047.12	78.3413%

A						
中信建投睿利C	888	33,013.74	2,190,017.57	7.4703%	27,126,184.88	92.5297%
合计	1,380	27,937.72	4,190,817.57	10.8700%	34,363,232.00	89.1300%

### 8.2 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	232,628.67	2.5182%
	中信建投睿利C	10,176.81	0.0347%
	合计	242,805.48	0.6298%

### 8.3 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
	中信建投睿利C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投睿利A	0
	中信建投睿利C	0
	合计	0

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	2,000,800.00	5.1896%	10,000,800.00	25.9397%	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人高	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

级管理人员					
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	2,000,800.00	5.1896%	10,000,800.00	25.9397%	-

## §9 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	-
本报告期期初基金份额总额	7,282,161.65	3,368,739.81
本报告期基金总申购份额	6,344,153.03	71,429,605.35
减：本报告期基金总赎回份额	4,388,467.56	45,482,142.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	9,237,847.12	29,316,202.45

## §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

本报告期内，高翔先生于2023年1月12日离任基金管理人副总经理、首席信息官，王欢女士于2023年3月31日起担任基金管理人财务负责人；

本报告期内，基金管理人因第三届董事会任期届满，第四届董事会成员调整变动，基金管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十。

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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	195,166,942.90	55.71%	103,693.71	55.74%	-
兴业证券	1	25,050.00	0.01%	15.81	0.01%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	2,149,991.46	0.61%	1,142.29	0.61%	-

国信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	5	153,003,173.58	43.67%	81,172.82	43.64%	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字〔2007〕48号）的规定及本基金管理人的《中信建投基金管理有限公司公募基金交易单元管理办法》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）证券经纪商的选择由公司权益投资一部负责人根据证券经纪商投资研究服务综合评价，作出交易单元开设或撤销的相关决定。经公司分管领导通过后，方可办理相关的交易单元开设或撤销事宜。

（2）权益投资一部每季度组织公募投研条线人员完成对各往来证券经纪商的研究服务评估。根据评估结果调整确定个别证券经纪商的交易金额及比率限制的参考。

（3）评估实行评分制，具体如下：

分配权重（100分）=基础研究服务（70%）+综合研究服务（20%）+特别研究服务（10%）。基础研究服务占70%权重和综合研究服务占20%权重，由公募投研条线人员进行打分；特别研究服务占10%权重，由系统跟踪股票涨跌幅后生成得分。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

### 10.7.2 基金租用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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	3,025,967.25	100.00%	46,600,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 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高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2023-01-13
2	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年第4季度报告提示性公告	规定报刊	2023-01-20
3	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金2022年第4季度报告	规定网站	2023-01-20
4	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	规定网站、规定报刊	2023-03-18
5	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	2023-03-22
6	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2023-03-22
7	中信建投基金管理有限公司董事变更公告	规定网站、规定报刊	2023-03-30
8	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	规定网站、规定报刊	2023-03-31



9	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年年度报告提示性公告	规定报刊	2023-03-31
10	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金2022年年度报告	规定网站	2023-03-31
11	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2023-04-01
12	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	2023-04-03
13	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2023-04-03
14	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在中信建投证券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	2023-04-13
15	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2023年第1季度报告提示性公告	规定报刊	2023-04-21
16	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金2023年第1季度报告	规定网站	2023-04-21
17	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在北京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	2023-05-08
18	中信建投基金管理有限公司关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金证券交易结算模式转换有关事项的公告	规定网站、规定报刊	2023-06-21

19	中信建投基金管理有限公司关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金证券交易结算模式转换完成的公告	规定网站、规定报刊	2023-06-22
20	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	规定网站、规定报刊	2023-06-22
21	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	2023-06-28
22	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2023-06-28

## §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
个人	1	20230101-20230320	3,300,789.47	-	3,078,081.00	222,708.47	0.5777%

#### 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。

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

## 12.3 查阅方式

投资者可以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  
二〇二三年八月三十一日